

pps *portfolio
performance*

Avaliação de Performance: RECKITT PREV

Março/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 12,23%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 9,58%, 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, afetado pelos eventos observados no início deste ano referentes à exposição nas debêntures das Lojas Americanas e nos ativos emitidos pela Light. O desempenho mensal, em nossa opinião, poderia ter sido melhor. Como era de se esperar, o histórico construído em períodos mais longos 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, em mais uma ocasião, nos pareceu razoável. O retorno acumulado, pouco abaixo do “benchmark” proposto, foi o 15º colocado entre 33 possibilidades. O risco total e o beta ocuparam a última colocação dos rankings elaborados pela PPS, enquanto o risco diversificável se mostrou elevado. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, poderiam ter sido melhores. Em março, há indícios de insucesso na seleção dos ativos e de sucesso em “timing”, sendo que ambos os fatores - alfa e gama - apresentaram baixa significância estatística. O histórico dos últimos doze meses, bem como o de períodos mais longos, deixou a desejar. Reitera-se que 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 três 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; 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; e, desde mar/23, o Western Asset Multitrading Premium FIC FIM, que busca a valorização dos capitais dos cotistas, mediante a exposição em cotas de fundos que apliquem em diferentes modalidades de investimentos. 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 registrou pequena valorização, consideravelmente abaixo da evolução do índice de referência (“benchmark”) estabelecido em sua Política de Investimentos. Por outro lado, o desempenho mensal se sobressaiu. Diante do exposto, a despeito da recuperação observada no ano corrente, ainda nos parece prudente manter o gestor “em observação”, lembrando que o histórico construído em períodos mais longos continuou ruim, dada a forte queda contabilizada em 2022.

CONSOLIDADO

- CARTEIRA CONSOLIDADA - (WESTERN) - Gestão Ativa: O desempenho mensal desta carteira consolidada acompanhou de perto a evolução do “benchmark” proposto. No entanto, o histórico dos últimos doze meses seguiu ruim, com destaque negativo para os recentes eventos que tiveram influência sobre comportamento do segmento de renda fixa. Diante do exposto, sugere-se que a Reckitt Prev acompanhe de perto as providências que o gestor irá desenvolver para tentar reverter este quadro. Cabe reiterar que a Entidade tem avançado em algumas discussões com o intuito de promover mudanças, sem renunciar a diversificação, um aspecto importantíssimo na construção de portfólios eficientes.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – MARÇO DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	28.603.171,86	16,76%
Renda Fixa (Ativa)	107.304.443,35	62,87%
Renda Variável	7.737.468,39	4,53%
Estruturado	17.109.863,92	10,03%
Exterior	9.911.203,23	5,81%
Total	170.666.150,75	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: -.-
RENTA FIXA (Títulos na Curva)*

Março/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: 5,20244
 PATRIMÔNIO: 28.603.171,86

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	97,24%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	2,43%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,02%	DÓLAR PTAX	0,30%

ESTILO: 1,80%

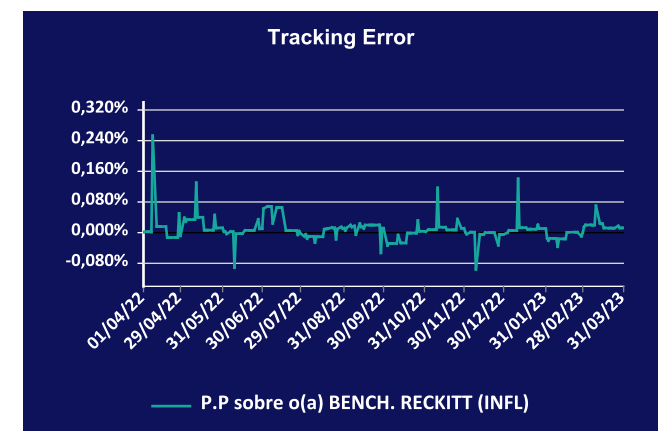
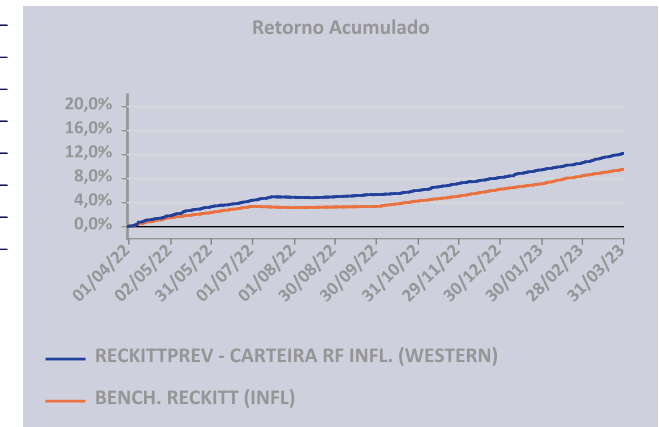
SELEÇÃO: 98,20%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0037%	--
RETORNO ACUMULADO	12,2334%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	9,5791%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	2,6543%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,1040	--
SORTINO	-0,1527	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	23,8704	--
DOWNSIDE RISK	0,0242%	--
RISCO ATIVO	0,0295%	--
RISCO TOTAL	0,0347%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,5510%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	8
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	4
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	1,48%	3,72%	12,23%	31,05%	45,72%	0,33% (08/04/2022)	-0,05% (28/09/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,05%	3,13%	9,58%	28,56%	44,35%	0,08% (01/04/2022)	-0,01% (14/07/2022)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,06% (01/04/2022)	-0,03% (06/07/2022)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,05% (01/04/2022)	-0,03% (06/07/2022)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 5,20244
 PATRIMÔNIO: 28.603.171,86

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,75%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,48%	IMA B 5+	0,77%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 5,17%

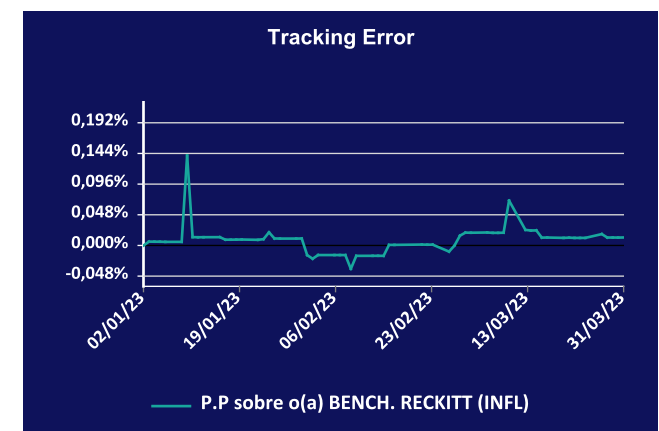
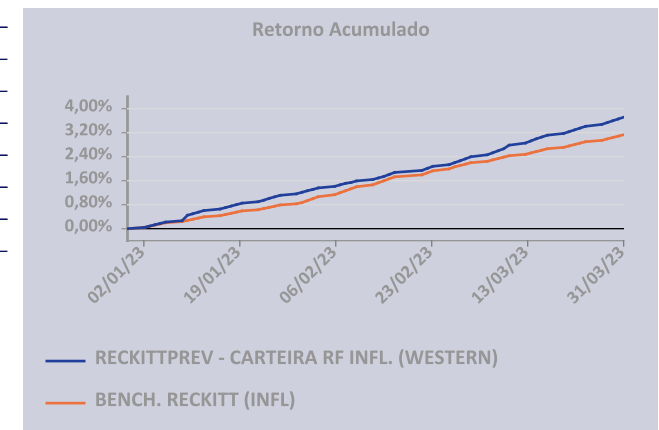
SELEÇÃO: 94,83%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0071%	--
RETORNO ACUMULADO	3,7159%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1317%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,5841%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,3700	--
SORTINO	1,9138	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	19,0464	--
DOWNSIDE RISK	0,0037%	--
RISCO ATIVO	0,0227%	--
RISCO TOTAL	0,0193%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,3064%	--

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	1,4828%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9762%(02/2023)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,48%	3,72%	12,23%	31,05%	45,72%	0,18% (10/01/2023)	0,03% (09/02/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,05%	3,13%	9,58%	28,56%	44,35%	0,07% (01/02/2023)	0,04% (02/01/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (13/03/2023)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	0,78% (15/02/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,36% (15/02/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,05% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,04% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

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: 5,20244
 PATRIMÔNIO: 28.603.171,86

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,13%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,87%

ESTILO: 20,79%

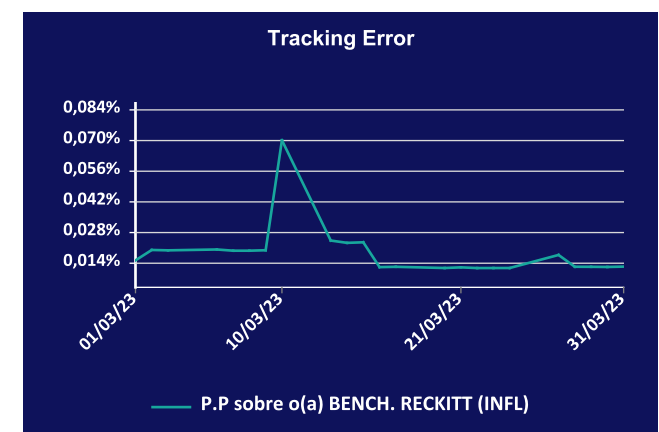
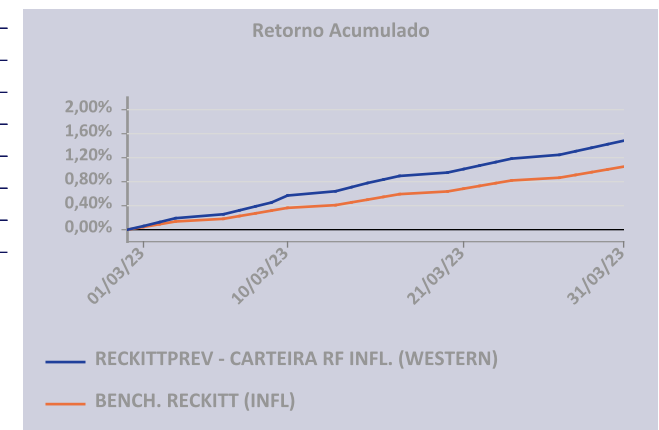
SELEÇÃO: 79,21%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0132%	--
RETORNO ACUMULADO	1,4827%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0500%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,4327%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	1,0933	--
SORTINO	--	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	14,3872	--
DOWNSIDE RISK	--	--
RISCO ATIVO	0,0120%	--
RISCO TOTAL	0,0120%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1920%	--

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	1,4828%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,4828%(03/2023)



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	1,48%	3,72%	12,23%	31,05%	45,72%	0,12% (10/03/2023)	0,06% (22/03/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,05%	3,13%	9,58%	28,56%	44,35%	0,05% (01/03/2023)	0,05% (01/03/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,38% (09/03/2023)	-0,15% (02/03/2023)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (13/03/2023)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	0,53% (09/03/2023)	-0,29% (02/03/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,26% (13/03/2023)	-0,14% (28/03/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	0,81% (09/03/2023)	-0,46% (02/03/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,28% (09/03/2023)	-0,11% (02/03/2023)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,03% (01/03/2023)	0,03% (01/03/2023)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,03% (01/03/2023)	0,03% (01/03/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	1,18% (15/03/2023)	-1,16% (27/03/2023)



Agrupamento: Renda Fixa
ÍNDICES (PPS)

Março/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: 2,90513
 PATRIMÔNIO: 107.304.443,35

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	77,84%	IRF-M	10,35%
IMA B 5	10,30%	IMA B 5+	1,13%
IMA-C	0,03%	DÓLAR PTAX	0,34%

ESTILO: 14,82%

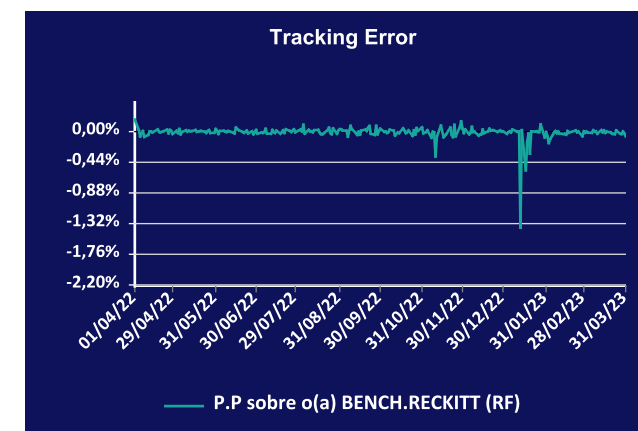
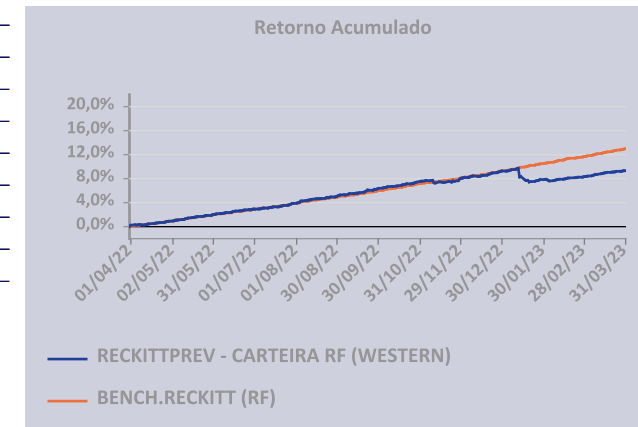
SELEÇÃO: 85,18%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0141%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	9,2960%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	12,9968%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,7007%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,9900	9° de 15
SHARPE	-0,1294	13° de 15
SORTINO	-0,1351	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	117,2221	--
DOWNSIDE RISK	0,1048%	4° de 15
RISCO ATIVO	0,1049%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1093%	5° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7356%	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	0,92%	0,02%	9,30%	15,57%	20,45%	0,25% (01/04/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,21%	3,36%	13,00%	21,80%	27,09%	0,10% (04/08/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,06% (01/04/2022)	-0,03% (04/07/2022)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,05% (01/04/2022)	-0,03% (04/07/2022)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 2,90513
 PATRIMÔNIO: 107.304.443,35

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	85,54%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,10%
IMA-C	12,77%	DÓLAR PTAX	1,59%

ESTILO: 1,39%

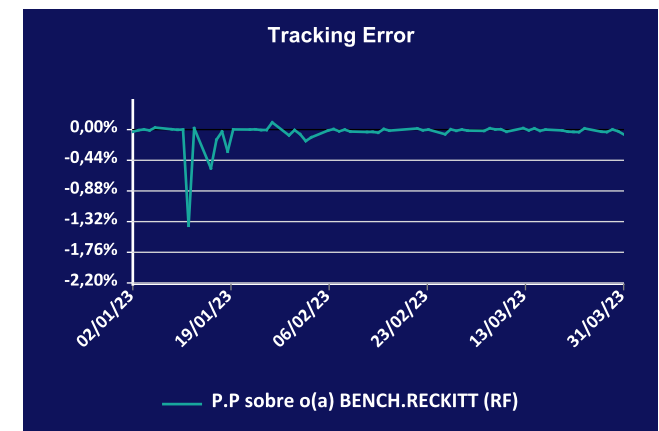
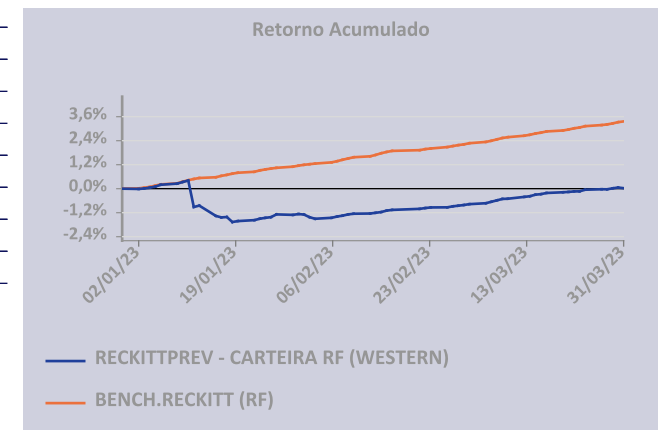
SELEÇÃO: 98,61%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0502%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,0247%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,3638%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,3391%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-4,3314	11° de 15
SHARPE	-0,2633	15° de 15
SORTINO	-0,2574	14° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	38,2348	--
DOWNSIDE RISK	0,1950%	2° de 15
RISCO ATIVO	0,1904%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1906%	2° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	3,0271%	2° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	3
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9159%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,2682%(01/2023)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,92%	0,02%	9,30%	15,57%	20,45%	0,14% (27/01/2023)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,21%	3,36%	13,00%	21,80%	27,09%	0,08% (15/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (13/03/2023)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	0,78% (15/02/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,36% (15/02/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,05% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,04% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

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: 2,90513
 PATRIMÔNIO: 107.304.443,35

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	79,71%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	19,29%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,00%

ESTILO: 70,18%

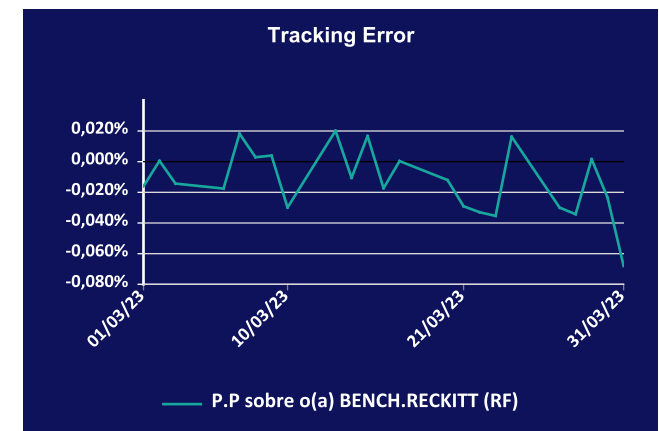
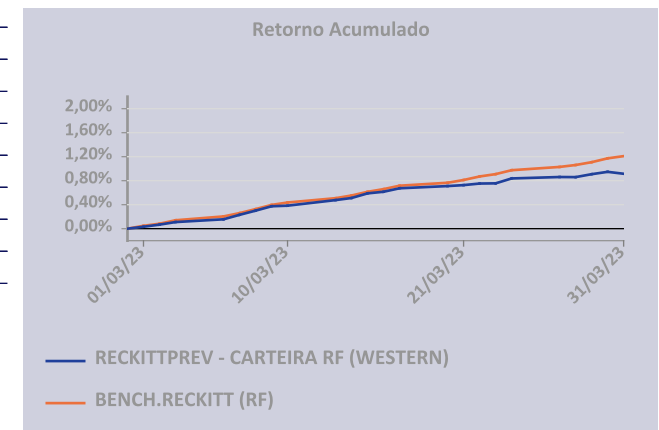
SELEÇÃO: 29,82%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0111%	15° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,9158%	15° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,2090%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2931%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-9,2483	13° de 15
SHARPE	-0,3700	15° de 15
SORTINO	-0,3980	15° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,7883	--
DOWNSIDE RISK	0,0279%	11° de 15
RISCO ATIVO	0,0216%	5° de 15
RISCO TOTAL	0,0300%	14° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4777%	14° 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	0,9159%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9159%(03/2023)



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	0,92%	0,02%	9,30%	15,57%	20,45%	0,09% (13/03/2023)	-0,03% (31/03/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,21%	3,36%	13,00%	21,80%	27,09%	0,07% (13/03/2023)	0,03% (28/03/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,38% (09/03/2023)	-0,15% (02/03/2023)
IMA-S	1,15%	3,30%	13,42%	21,36%	23,59%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (13/03/2023)
IMA-B	2,66%	3,98%	7,51%	12,36%	24,02%	0,53% (09/03/2023)	-0,29% (02/03/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,26% (13/03/2023)	-0,14% (28/03/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	0,81% (09/03/2023)	-0,46% (02/03/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,28% (09/03/2023)	-0,11% (02/03/2023)
IPCA	0,71%	2,09%	4,65%	16,48%	23,58%	0,03% (01/03/2023)	0,03% (01/03/2023)
INPC	0,64%	1,88%	4,36%	16,60%	24,69%	0,03% (01/03/2023)	0,03% (01/03/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	1,18% (15/03/2023)	-1,16% (27/03/2023)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2022 A 31/03/2023
 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	0,9904	13,1345%	-0,0055	1,4313%	0,77%	93.645.783,79	252
2	CLIENTE V - SANTANDER	-0,4894	12,9719%	-0,0525	0,3336%	0,20%	605.772.115,85	252
3	CLIENTE V - BRADESCO	-0,6414	10,7970%	-0,0612	2,2638%	0,34%	261.432.320,43	252
4	CLIENTE V - ITAÚ	-0,8655	11,2310%	-0,0618	1,8492%	0,38%	314.993.316,46	252
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-1,1572	12,0019%	-0,0493	1,4425%	0,10%	721.615.179,90	252
6	CLIENTE X - ITAU	-1,3654	11,9816%	-0,0572	1,2664%	0,13%	1.065.492.776,45	252
7	CLIENTE Y - BNP	-1,4176	11,4569%	-0,0795	1,2834%	0,16%	268.870.395,06	252
8	CLIENTE D - WESTERN	-1,6872	9,3875%	-0,1145	1,9159%	0,00%	245.611.658,36	252
9	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,9901	9,2961%	-0,1295	1,7357%	0,35%	107.304.443,35	252
10	CLIENTE V - WESTERN	-2,3550	7,4525%	-0,1348	2,4572%	0,38%	102.355.550,04	252
11	CLIENTE X - BRADESCO	-2,4484	13,5467%	0,0293	0,4974%	0,13%	959.990.372,05	252
12	CLIENTE Y - WESTERN	-2,6148	11,0353%	-0,1266	0,9958%	0,10%	268.952.684,85	252
13	CLIENTE X - WESTERN	-2,9506	11,5059%	-0,1068	0,9316%	0,10%	948.967.656,59	252
14	CLIENTE O - SANTANDER	-4,3763	11,5487%	-0,1341	0,7246%	0,18%	354.500.200,33	252
15	CLIENTE O - BRADESCO	-4,7262	13,1485%	-0,0150	0,5109%	0,18%	341.311.940,04	252
	MÉDIA:	-1,8730	11,3664%	-0,0733	1,3093%		444.054.426,24	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/03/2023
 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	-0,4327	3,4035%	0,0196	1,9667%	0,34%	261.432.320,43	63
2	CLIENTE Y - BNP	-0,6108	3,5219%	0,0633	1,0504%	0,16%	268.870.395,06	63
3	CLIENTE M - BAHIA	-1,4338	3,1437%	-0,0170	1,4927%	0,77%	93.645.783,79	63
4	CLIENTE O - BRADESCO	-1,5533	3,5385%	0,0890	0,7910%	0,18%	341.311.940,04	63
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-1,7875	3,5405%	0,0767	0,9255%	0,10%	721.615.179,90	63
6	CLIENTE V - ITAÚ	-1,9309	3,3314%	0,0127	1,6132%	0,38%	314.993.316,46	63
7	CLIENTE X - ITAU	-2,8930	3,3395%	0,0236	0,9291%	0,13%	1.065.492.776,45	63
8	CLIENTE X - BRADESCO	-3,8171	3,4791%	0,0729	0,7668%	0,13%	959.990.372,05	63
9	CLIENTE V - SANTANDER	-3,8275	2,8935%	-0,1853	0,4708%	0,20%	605.772.115,85	63
10	CLIENTE D - WESTERN	-4,2536	0,6672%	-0,2202	2,8888%	0,00%	245.611.658,36	63
11	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-4,3314	0,0247%	-0,2633	3,0272%	0,35%	107.304.443,35	63
12	CLIENTE V - WESTERN	-4,5907	-0,0197%	-0,2418	3,3403%	0,38%	102.355.550,04	63
13	CLIENTE Y - WESTERN	-5,2665	2,5352%	-0,1706	1,0254%	0,10%	268.952.684,85	63
14	CLIENTE X - WESTERN	-5,4357	1,9214%	-0,2317	1,4067%	0,10%	948.967.656,59	63
15	CLIENTE O - SANTANDER	-5,5663	1,8832%	-0,2590	1,2955%	0,18%	354.500.200,33	63
	MÉDIA:	-3,1821	2,4802%	-0,0821	1,5327%		444.054.426,24	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/03/2023
 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	3,5690	1,6606%	0,2597	1,2761%	0,77%	93.645.783,79	23
2	CLIENTE Y - BNP	2,0659	1,3426%	0,1294	0,8870%	0,16%	268.870.395,06	23
3	CLIENTE V - SANTANDER	1,4049	1,2151%	0,1167	0,2364%	0,20%	605.772.115,85	23
4	CLIENTE V - ITAÚ	1,0084	1,6580%	0,2441	1,3504%	0,38%	314.993.316,46	23
5	CLIENTE V - BRADESCO	0,5450	1,6341%	0,2519	1,2439%	0,34%	261.432.320,43	23
6	CLIENTE X - BNP PARIBAS	0,4449	1,3428%	0,1479	0,7766%	0,10%	721.615.179,90	23
7	CLIENTE X - ITAU	0,1864	1,3405%	0,1081	1,0491%	0,13%	1.065.492.776,45	23
8	CLIENTE O - BRADESCO	-0,7998	1,2526%	0,0835	0,6378%	0,18%	341.311.940,04	23
9	CLIENTE X - BRADESCO	-4,5108	1,2556%	0,0909	0,6086%	0,13%	959.990.372,05	23
10	CLIENTE X - WESTERN	-7,5136	1,0036%	-0,1440	0,8104%	0,10%	948.967.656,59	23
11	CLIENTE O - SANTANDER	-8,3509	1,0862%	-0,0872	0,6918%	0,18%	354.500.200,33	23
12	CLIENTE D - WESTERN	-8,5029	1,3370%	0,1160	0,9569%	0,00%	245.611.658,36	23
13	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-9,2483	0,9159%	-0,3701	0,4778%	0,35%	107.304.443,35	23
14	CLIENTE Y - WESTERN	-11,2024	1,1585%	-0,0177	0,6166%	0,10%	268.952.684,85	23
15	CLIENTE V - WESTERN	-12,6364	1,2812%	0,0647	1,1288%	0,38%	102.355.550,04	23
	MÉDIA:	-3,5694	1,2990%	0,0663	0,8499%		444.054.426,24	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2022 A 31/03/2023
 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	13,5467%	0,0293	0,0009%	0,4974%	0,13%	959.990.372,05	252
2	CLIENTE O - BRADESCO	13,1485%	-0,0150	-0,0005%	0,5109%	0,18%	341.311.940,04	252
3	CLIENTE M - BAHIA	13,1345%	-0,0055	-0,0005%	1,4313%	0,77%	93.645.783,79	252
4	CLIENTE V - SANTANDER	12,9719%	-0,0525	-0,0011%	0,3336%	0,20%	605.772.115,85	252
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	12,0019%	-0,0493	-0,0045%	1,4425%	0,10%	721.615.179,90	252
6	CLIENTE X - ITAU	11,9816%	-0,0572	-0,0046%	1,2664%	0,13%	1.065.492.776,45	252
7	CLIENTE O - SANTANDER	11,5487%	-0,1341	-0,0061%	0,7246%	0,18%	354.500.200,33	252
8	CLIENTE X - WESTERN	11,5059%	-0,1068	-0,0063%	0,9316%	0,10%	948.967.656,59	252
9	CLIENTE Y - BNP	11,4569%	-0,0795	-0,0064%	1,2834%	0,16%	268.870.395,06	252
10	CLIENTE V - ITAÚ	11,2310%	-0,0618	-0,0072%	1,8492%	0,38%	314.993.316,46	252
11	CLIENTE Y - WESTERN	11,0353%	-0,1266	-0,0080%	0,9958%	0,10%	268.952.684,85	252
12	CLIENTE V - BRADESCO	10,7970%	-0,0612	-0,0087%	2,2638%	0,34%	261.432.320,43	252
13	CLIENTE D - WESTERN	9,3875%	-0,1145	-0,0138%	1,9159%	0,00%	245.611.658,36	252
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	9,2961%	-0,1295	-0,0142%	1,7357%	0,35%	107.304.443,35	252
15	CLIENTE V - WESTERN	7,4525%	-0,1348	-0,0209%	2,4572%	0,38%	102.355.550,04	252
	MÉDIA:	11,3664%	-0,0733	-0,0068%	1,3093%		444.054.426,24	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/03/2023
 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

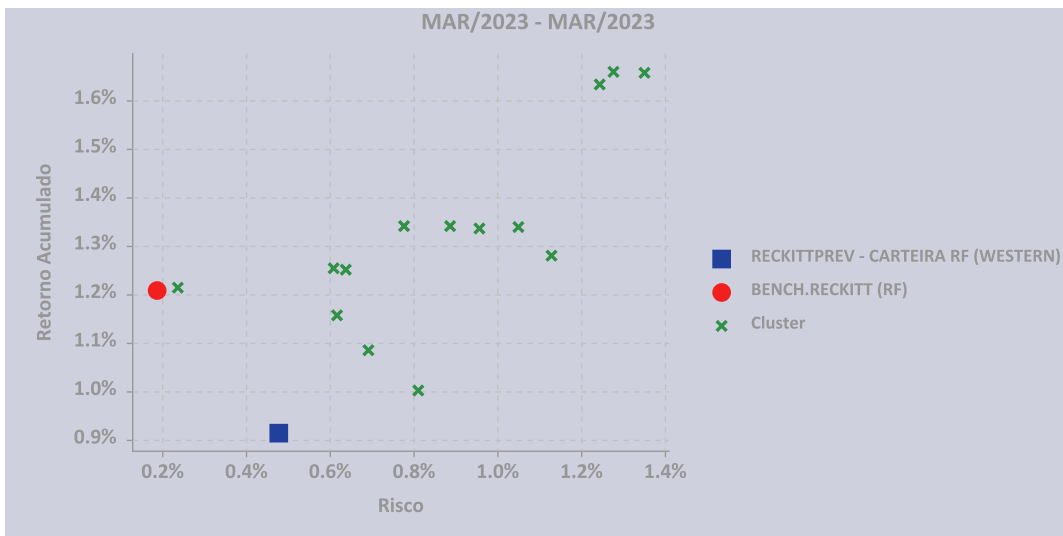
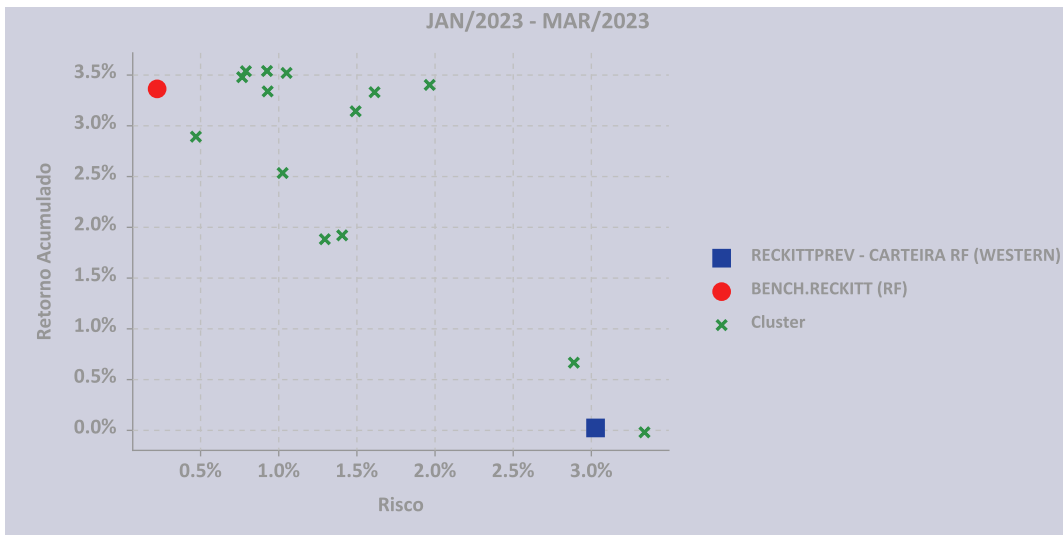
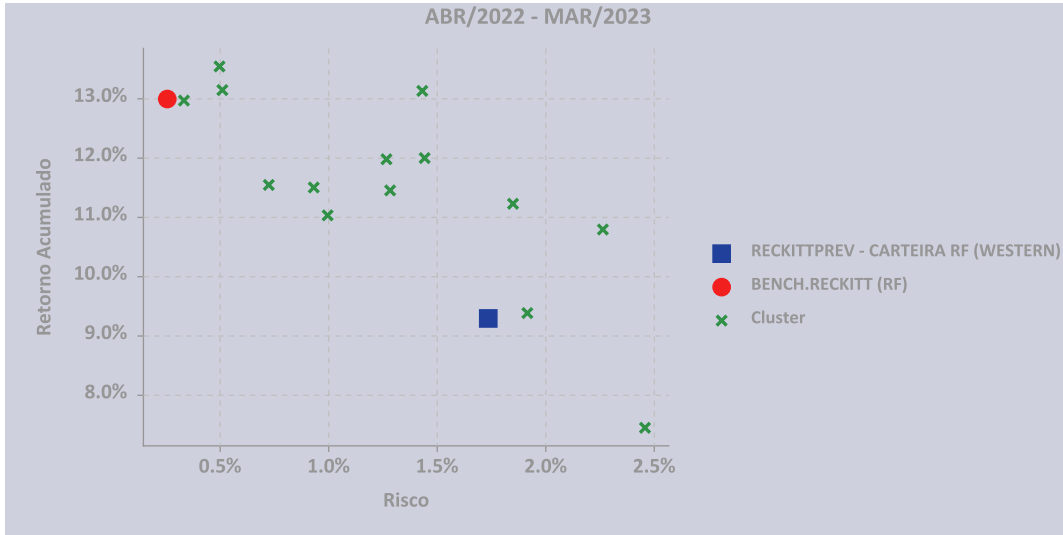
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE X - BNP PARIBAS	3,5405%	0,0767	0,0045%	0,9255%	0,10%	721.615.179,90	63
2	CLIENTE O - BRADESCO	3,5385%	0,0890	0,0044%	0,7910%	0,18%	341.311.940,04	63
3	CLIENTE Y - BNP	3,5219%	0,0633	0,0042%	1,0504%	0,16%	268.870.395,06	63
4	CLIENTE X - BRADESCO	3,4791%	0,0729	0,0035%	0,7668%	0,13%	959.990.372,05	63
5	CLIENTE V - BRADESCO	3,4035%	0,0196	0,0024%	1,9667%	0,34%	261.432.320,43	63
6	CLIENTE X - ITAU	3,3395%	0,0236	0,0014%	0,9291%	0,13%	1.065.492.776,45	63
7	CLIENTE V - ITAÚ	3,3314%	0,0127	0,0013%	1,6132%	0,38%	314.993.316,46	63
8	CLIENTE M - BAHIA	3,1437%	-0,0170	-0,0016%	1,4927%	0,77%	93.645.783,79	63
9	CLIENTE V - SANTANDER	2,8935%	-0,1853	-0,0055%	0,4708%	0,20%	605.772.115,85	63
10	CLIENTE Y - WESTERN	2,5352%	-0,1706	-0,0110%	1,0254%	0,10%	268.952.684,85	63
11	CLIENTE X - WESTERN	1,9214%	-0,2317	-0,0205%	1,4067%	0,10%	948.967.656,59	63
12	CLIENTE O - SANTANDER	1,8832%	-0,2590	-0,0211%	1,2955%	0,18%	354.500.200,33	63
13	CLIENTE D - WESTERN	0,6672%	-0,2202	-0,0401%	2,8888%	0,00%	245.611.658,36	63
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,0247%	-0,2633	-0,0502%	3,0272%	0,35%	107.304.443,35	63
15	CLIENTE V - WESTERN	-0,0197%	-0,2418	-0,0509%	3,3403%	0,38%	102.355.550,04	63
	MÉDIA:	2,4802%	-0,0821	-0,0119%	1,5327%		444.054.426,24	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/03/2023
 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 M - BAHIA	1,6606%	0,2597	0,0209%	1,2761%	0,77%	93.645.783,79	23
2	CLIENTE V - ITAÚ	1,6580%	0,2441	0,0208%	1,3504%	0,38%	314.993.316,46	23
3	CLIENTE V - BRADESCO	1,6341%	0,2519	0,0197%	1,2439%	0,34%	261.432.320,43	23
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	1,3428%	0,1479	0,0072%	0,7766%	0,10%	721.615.179,90	23
5	CLIENTE Y - BNP	1,3426%	0,1294	0,0072%	0,8870%	0,16%	268.870.395,06	23
6	CLIENTE X - ITAU	1,3405%	0,1081	0,0071%	1,0491%	0,13%	1.065.492.776,45	23
7	CLIENTE D - WESTERN	1,3370%	0,1160	0,0070%	0,9569%	0,00%	245.611.658,36	23
8	CLIENTE V - WESTERN	1,2812%	0,0647	0,0046%	1,1288%	0,38%	102.355.550,04	23
9	CLIENTE X - BRADESCO	1,2556%	0,0909	0,0035%	0,6086%	0,13%	959.990.372,05	23
10	CLIENTE O - BRADESCO	1,2526%	0,0835	0,0034%	0,6378%	0,18%	341.311.940,04	23
11	CLIENTE V - SANTANDER	1,2151%	0,1167	0,0017%	0,2364%	0,20%	605.772.115,85	23
12	CLIENTE Y - WESTERN	1,1585%	-0,0177	-0,0007%	0,6166%	0,10%	268.952.684,85	23
13	CLIENTE O - SANTANDER	1,0862%	-0,0872	-0,0038%	0,6918%	0,18%	354.500.200,33	23
14	CLIENTE X - WESTERN	1,0036%	-0,1440	-0,0073%	0,8104%	0,10%	948.967.656,59	23
15	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,9159%	-0,3701	-0,0111%	0,4778%	0,35%	107.304.443,35	23
	MÉDIA:	1,2990%	0,0663	0,0053%	0,8499%		444.054.426,24	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Março/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: 1,81235
 PATRIMÔNIO: 7.737.468,39

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	89,15%
	IVBX-2	6,73%	SMLL	1,48%
	IDIV	0,00%	IRF-M	2,32%
	IMA-B	0,31%		

ESTILO: 98,91%

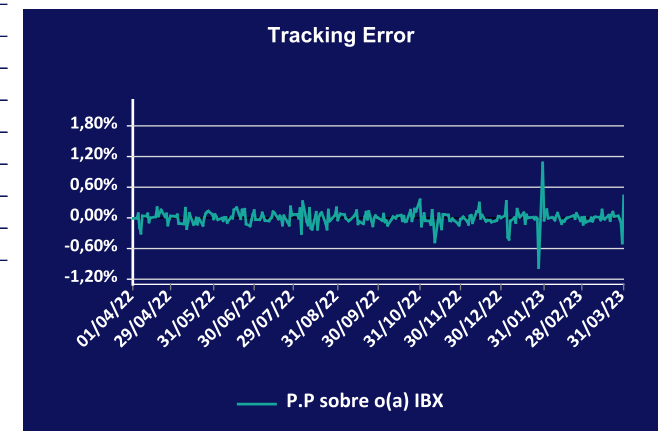
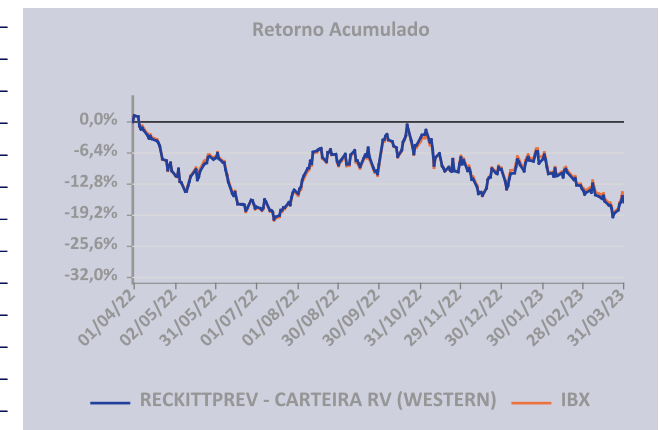
SELEÇÃO: 1,09%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1121%	30° de 33
RETORNO ACUMULADO	-16,4754%	30° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-16,0473%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4281%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0027%	19° de 33
BETA	0,9761	27° de 33
MARKET TIMING	-0,4223	30° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9880	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	19,9981%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	80,6743%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2485	31° de 33
JENSEN	-1,1138%	31° de 33
MODIGLIANI	-0,9558%	31° de 33
SHARPE	-0,0844	31° de 33
SORTINO	-0,1109	31° de 33
TREYNOR	-0,0011	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	20,1374	--
DOWNSIDE RISK	1,0105%	16° de 33
RISCO ATIVO	0,1493%	8° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,3702%	8° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1459%	9° de 33
RISCO TOTAL	1,3278%	23° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	21,0794%	23° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	6
MESES NEGATIVOS	6
MESES ACIMA DO IBX	7
MESES ABAIXO DO IBX	5
MAIOR RETORNO MENSAL	6,0384%(10/2022)
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	-3,17%	-7,48%	-16,48%	-16,57%	34,62%	5,54% (03/10/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	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: 1,81235
 PATRIMÔNIO: 7.737.468,39

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	88,82%
	IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
	IDIV	6,48%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	4,70%		

ESTILO: 95,91%

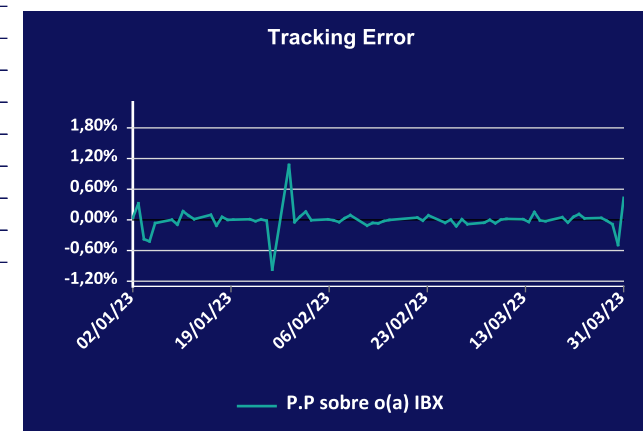
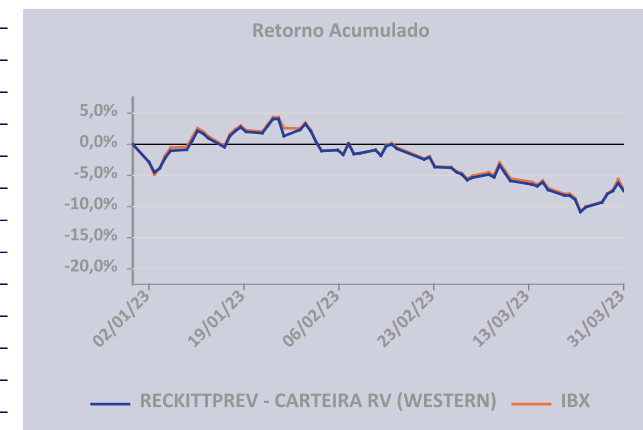
SELEÇÃO: 4,09%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1671%	24° de 33
RETORNO ACUMULADO	-7,4802%	24° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-7,2747%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2055%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0196%	4° de 33
BETA	0,9477	32° de 33
MARKET TIMING	-2,1518	32° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9664	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	39,6508%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	77,7683%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2739	20° de 33
JENSEN	-0,6766%	31° de 33
MODIGLIANI	-0,5131%	31° de 33
SHARPE	-0,1409	31° de 33
SORTINO	-0,1765	24° de 33
TREYNOR	-0,0017	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	14,3072	--
DOWNSIDE RISK	0,9469%	24° de 33
RISCO ATIVO	0,2267%	7° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	3,6003%	7° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,2201%	7° de 33
RISCO TOTAL	1,1860%	27° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	18,8276%	27° 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	-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	-3,17%	-7,48%	-16,48%	-16,57%	34,62%	2,07% (08/03/2023)	-2,84% (02/01/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	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: 1,81235
 PATRIMÔNIO: 7.737.468,39

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	7,43%	IBX	79,95%
	IVBX-2	7,07%	SMLL	0,00%
	IDIV	5,55%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	0,00%		

ESTILO: 98,86%

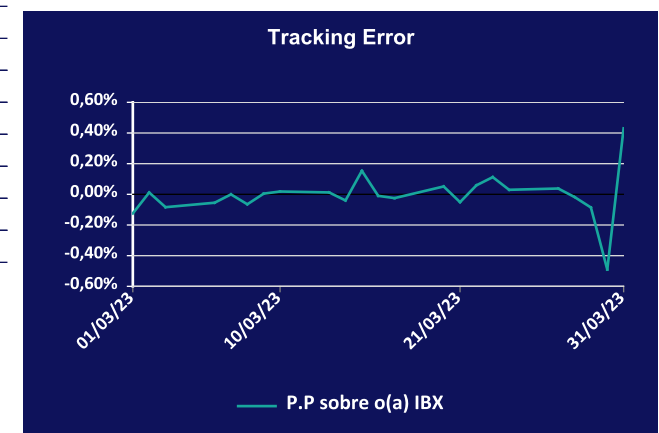
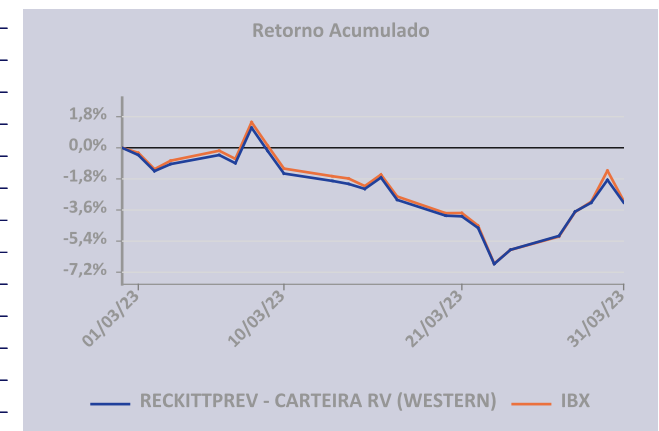
SELEÇÃO: 1,14%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1852%	15° de 33
RETORNO ACUMULADO	-3,1697%	15° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-3,0663%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1033%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0205%	15° de 33
BETA	0,9213	33° de 33
MARKET TIMING	0,0705	20° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9870	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	42,7828%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	3,0435%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,5751	15° de 33
JENSEN	-0,4374%	20° de 33
MODIGLIANI	-0,4441%	21° de 33
SHARPE	-0,1725	21° de 33
SORTINO	-0,2222	20° de 33
TREYNOR	-0,0020	23° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	7,4141	--
DOWNSIDE RISK	0,8334%	33° de 33
RISCO ATIVO	0,1526%	7° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,4226%	7° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1223%	8° de 33
RISCO TOTAL	1,0734%	33° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,0404%	33° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-3,1697%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-3,1697%(03/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-3,17%	-7,48%	-16,48%	-16,57%	34,62%	2,07% (08/03/2023)	-2,19% (23/03/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	1,69% (30/03/2023)	-1,63% (17/03/2023)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2022 A 31/03/2023
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	5,0035%	1,0054	-12,4666%	22,7078%	1,70%	81.830.756,36	252
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	4,3634%	0,9313	-10,3808%	20,3337%	0,75%	79.877.509,85	252
3	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	3,5273%	0,8797	-9,9788%	19,3407%	0,41%	403.598.474,71	252
4	IAJA SAM ACOES FI	3,1557%	1,0100	-13,3135%	21,7990%	0,22%	126.139.505,95	252
5	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	2,8366%	0,9447	-12,2158%	20,6478%	2,00%	342.080.699,64	252
6	OCEANA VALOR FC FI ACOES	2,7958%	0,9338	-12,0966%	20,5197%	2,00%	277.209.291,77	252
7	IAJA ACOES FC FIA	2,4544%	0,9946	-13,6430%	21,4932%	0,08%	199.400.889,34	252
8	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,5351%	1,0254	-15,2590%	22,0295%	0,70%	28.484.803,34	252
9	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	1,0567%	0,9899	-14,7281%	21,2541%	0,00%	346.868.513,75	252
10	BRAM FIA IBRX ATIVO	1,0426%	0,9903	-14,7516%	21,2613%	0,00%	385.929.432,63	252
11	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	1,0369%	0,9915	-14,7930%	21,2884%	0,00%	122.967.854,08	252
12	MULTIPREV FIA	0,9226%	0,9806	-14,6240%	21,0752%	0,00%	662.577.249,27	252
13	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,8910%	1,0068	-15,3562%	21,6040%	0,00%	170.722.247,32	252
14	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,6528%	1,0006	-15,4124%	21,4666%	0,00%	1.042.412.041,51	252
15	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,5607%	0,9779	-14,8629%	20,9882%	0,00%	204.192.106,59	252
16	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,4931%	1,0002	-15,5605%	21,4579%	0,15%	168.832.687,45	252
17	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,4873%	0,9798	-14,9775%	21,0201%	0,30%	33.884.992,32	252
18	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,3914%	0,9900	-15,3879%	21,2545%	0,70%	11.029.073,87	252
19	BRADESCO FIA SALUBRE	0,3633%	0,9829	-15,2074%	21,1003%	0,50%	122.683.817,42	252
20	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,3450%	0,9767	-15,0462%	20,9677%	0,00%	64.919.037,23	252
21	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3300%	1,0004	-15,7278%	21,4610%	0,30%	49.184.530,02	252
22	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,3079%	0,9974	-15,6827%	21,4114%	0,56%	69.952.957,42	252
23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,2786%	0,9933	-15,5759%	21,3109%	0,15%	125.820.536,36	252
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,2785%	0,9946	-15,6107%	21,3365%	0,19%	25.485.164,24	252
25	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,2217%	0,9906	-15,5737%	21,2676%	0,90%	196.396.128,76	252
26	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,2087%	0,9976	-15,7705%	21,4030%	0,10%	523.411.478,15	252
27	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,1525%	0,9705	-15,1151%	20,8800%	0,15%	61.290.793,18	252
28	COMSHELL CONCHA FIA	0,0485%	0,9847	-15,5537%	21,1272%	0,17%	64.288.400,74	252
29	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,0687%	0,9815	-17,2713%	22,2961%	1,85%	161.215.265,59	252
30	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,4625%	0,9637	-15,4502%	20,6903%	0,75%	34.008.147,14	252
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,9559%	0,9762	-16,4754%	21,0795%	0,35%	7.737.468,39	252
32	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-1,0342%	0,9967	-16,9943%	21,3917%	0,09%	359.505.608,51	252
33	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-1,1509%	0,9955	-17,0758%	21,3671%	0,01%	359.780.523,08	252
	MÉDIA:	0,9718%	0,9829	-14,7860%	21,2313%		209.506.605,64	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/03/2023
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	1,6739%	0,9481	-5,5232%	19,1976%	1,85%	161.215.265,59	63
2	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,9059%	1,0162	-6,6685%	19,9707%	2,00%	342.080.699,64	63
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	0,8695%	1,0151	-6,6988%	19,9562%	2,00%	277.209.291,77	63
4	RPS FIC FI ACOES SELECTION	0,7081%	1,1501	-8,6387%	23,4551%	1,70%	81.830.756,36	63
5	IAJA ACOES FC FIA	0,5216%	0,9880	-6,7346%	19,3317%	0,08%	199.400.889,34	63
6	MULTIPREV FIA	0,3382%	1,0137	-7,0927%	19,6644%	0,00%	662.577.249,27	63
7	IAJA SAM ACOES FI	0,3013%	1,0001	-7,0731%	19,5562%	0,22%	126.139.505,95	63
8	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,1837%	1,0000	-7,0907%	19,3668%	0,00%	1.042.412.041,51	63
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,1671%	0,9995	-7,0959%	19,3455%	0,15%	168.832.687,45	63
10	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0986%	1,0001	-7,1764%	19,3679%	0,30%	49.184.530,02	63
11	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,0745%	1,0064	-7,2528%	19,4647%	0,00%	170.722.247,32	63
12	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0631%	0,9980	-7,1911%	19,3293%	0,10%	523.411.478,15	63
13	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0612%	0,9629	-6,8275%	18,6529%	0,30%	33.884.992,32	63
14	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0489%	0,9972	-7,1967%	19,3134%	0,19%	25.485.164,24	63
15	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0451%	0,9954	-7,1846%	19,2840%	0,15%	125.820.536,36	63
16	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0114%	0,9932	-7,2043%	19,2586%	0,56%	69.952.957,42	63
17	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0102%	1,0097	-7,3590%	19,5413%	0,70%	28.484.803,34	63
18	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,0626%	0,9710	-7,0312%	18,8074%	0,00%	204.192.106,59	63
19	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1070%	0,9882	-7,2720%	19,1675%	0,17%	64.288.400,74	63
20	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,1312%	0,9717	-7,1155%	18,8397%	0,00%	64.919.037,23	63
21	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-0,2671%	0,9922	-7,4717%	19,2415%	0,00%	122.967.854,08	63
22	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,2698%	0,9885	-7,4331%	19,1674%	0,00%	385.929.432,63	63
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,3362%	0,9905	-7,5202%	19,2056%	0,00%	346.868.513,75	63
24	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,3674%	0,9522	-7,1354%	18,4663%	0,75%	34.008.147,14	63
25	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,3953%	0,9686	-7,3446%	18,7902%	0,15%	61.290.793,18	63
26	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,4592%	0,9922	-7,6483%	19,2165%	0,09%	359.505.608,51	63
27	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,4742%	0,9903	-7,6518%	19,1964%	0,70%	11.029.073,87	63
28	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,4776%	0,9916	-7,6595%	19,2039%	0,01%	359.780.523,08	63
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,4914%	0,9888	-7,6548%	19,1716%	0,90%	196.396.128,76	63
30	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,5078%	0,9838	-7,6131%	19,0701%	0,50%	122.683.817,42	63
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,5131%	0,9477	-7,4803%	18,8277%	0,35%	7.737.468,39	63
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,3011%	0,9201	-7,8438%	18,1686%	0,41%	403.598.474,71	63
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-1,7264%	0,9483	-8,5507%	18,6552%	0,75%	79.877.509,85	63
	MÉDIA:	-0,0547%	0,9903	-7,2859%	19,3107%		209.506.605,64	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/03/2023
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	0,8898%	1,3214	-3,6195%	26,2894%	1,70%	81.830.756,36	23
2	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,1667%	1,0081	-2,9312%	18,5193%	0,00%	170.722.247,32	23
3	MULTIPREV FIA	0,1426%	1,0234	-3,0314%	18,8593%	0,00%	662.577.249,27	23
4	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,0693%	1,0008	-3,0005%	18,3924%	0,00%	1.042.412.041,51	23
5	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0538%	1,0011	-3,0175%	18,3987%	0,15%	168.832.687,45	23
6	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0426%	0,9990	-3,0199%	18,3603%	0,10%	523.411.478,15	23
7	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0397%	1,0009	-3,0309%	18,3953%	0,30%	49.184.530,02	23
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0383%	0,9932	-3,0018%	18,2623%	0,15%	125.820.536,36	23
9	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0322%	0,9970	-3,0224%	18,3259%	0,19%	25.485.164,24	23
10	COMSHELL CONCHA FIA	0,0287%	0,9884	-2,9889%	18,1644%	0,17%	64.288.400,74	23
11	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0577%	0,9520	-2,9157%	17,4864%	0,30%	33.884.992,32	23
12	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0631%	0,9965	-3,1176%	18,3262%	0,56%	69.952.957,42	23
13	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,0657%	0,9693	-3,0001%	17,8141%	0,00%	64.919.037,23	23
14	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,0789%	1,0848	-3,6442%	20,4999%	2,00%	342.080.699,64	23
15	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-0,0977%	1,0861	-3,6714%	20,5257%	2,00%	277.209.291,77	23
16	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,1372%	0,9728	-3,0840%	17,8749%	0,00%	204.192.106,59	23
17	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,1601%	0,9452	-2,9856%	17,3713%	0,75%	34.008.147,14	23
18	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,2686%	1,0147	-3,3928%	18,6127%	0,70%	28.484.803,34	23
19	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,2800%	0,9780	-3,2502%	17,9861%	0,15%	61.290.793,18	23
20	IAJA ACOES FC FIA	-0,4218%	0,9896	-3,4587%	18,2607%	0,08%	199.400.889,34	23
21	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,4441%	0,9213	-3,1697%	17,0405%	0,35%	7.737.468,39	23
22	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,4533%	0,9900	-3,4711%	18,1868%	0,09%	359.505.608,51	23
23	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,4608%	0,9892	-3,4748%	18,1725%	0,01%	359.780.523,08	23
24	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,5632%	0,9957	-3,6140%	18,3173%	0,00%	346.868.513,75	23
25	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,5745%	0,9923	-3,6079%	18,2515%	0,00%	385.929.432,63	23
26	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-0,5765%	0,9982	-3,6400%	18,3662%	0,00%	122.967.854,08	23
27	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,5793%	0,9930	-3,6151%	18,2606%	0,50%	122.683.817,42	23
28	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,5912%	0,9933	-3,6289%	18,2679%	0,70%	11.029.073,87	23
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,6563%	0,9928	-3,6914%	18,2596%	0,90%	196.396.128,76	23
30	IAJA SAM ACOES FI	-0,7277%	1,0045	-3,8225%	18,4821%	0,22%	126.139.505,95	23
31	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,7722%	0,9283	-3,6085%	17,5337%	1,85%	161.215.265,59	23
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-0,9236%	0,9616	-3,9008%	18,0599%	0,41%	403.598.474,71	23
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-1,2451%	0,9600	-4,2381%	18,1311%	0,75%	79.877.509,85	23
	MÉDIA:	-0,2635%	1,0013	-3,3536%	18,5471%		209.506.605,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2022 A 31/03/2023
 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	-9,9788%	2,5664%	0,8797	19,3407%	0,41%	403.598.474,71	252
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-10,3808%	3,6619%	0,9313	20,3337%	0,75%	79.877.509,85	252
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-12,0966%	1,9982%	0,9338	20,5197%	2,00%	277.209.291,77	252
4	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-12,2158%	2,2102%	0,9447	20,6478%	2,00%	342.080.699,64	252
5	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-12,4666%	3,7665%	1,0054	22,7078%	1,70%	81.830.756,36	252
6	IAJA SAM ACOES FI	-13,3135%	3,0354%	1,0100	21,7990%	0,22%	126.139.505,95	252
7	IAJA ACOES FC FIA	-13,6430%	2,2573%	0,9946	21,4932%	0,08%	199.400.889,34	252
8	MULTIPREV FIA	-14,6240%	0,8568%	0,9806	21,0752%	0,00%	662.577.249,27	252
9	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-14,7281%	1,0240%	0,9899	21,2541%	0,00%	346.868.513,75	252
10	BRAM FIA IBRX ATIVO	-14,7516%	1,0106%	0,9903	21,2613%	0,00%	385.929.432,63	252
11	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-14,7930%	1,0064%	0,9915	21,2884%	0,00%	122.967.854,08	252
12	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-14,8629%	0,5377%	0,9779	20,9882%	0,00%	204.192.106,59	252
13	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-14,9775%	0,4747%	0,9798	21,0201%	0,30%	33.884.992,32	252
14	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-15,0462%	0,3204%	0,9767	20,9677%	0,00%	64.919.037,23	252
15	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-15,1151%	0,0634%	0,9705	20,8800%	0,15%	61.290.793,18	252
16	BRADESCO FIA SALUBRE	-15,2074%	0,3350%	0,9829	21,1003%	0,50%	122.683.817,42	252
17	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-15,2590%	1,5311%	1,0254	22,0295%	0,70%	28.484.803,34	252
18	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-15,3562%	0,8901%	1,0068	21,6040%	0,00%	170.722.247,32	252
19	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-15,3879%	0,3643%	0,9900	21,2545%	0,70%	11.029.073,87	252
20	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-15,4124%	0,6529%	1,0006	21,4666%	0,00%	1.042.412.041,51	252
21	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-15,4502%	-0,4644%	0,9637	20,6903%	0,75%	34.008.147,14	252
22	COMSHELL CONCHA FIA	-15,5537%	0,0454%	0,9847	21,1272%	0,17%	64.288.400,74	252
23	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-15,5605%	0,4928%	1,0002	21,4579%	0,15%	168.832.687,45	252
24	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-15,5737%	0,1971%	0,9906	21,2676%	0,90%	196.396.128,76	252
25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-15,5759%	0,2757%	0,9933	21,3109%	0,15%	125.820.536,36	252
26	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-15,6107%	0,2763%	0,9946	21,3365%	0,19%	25.485.164,24	252
27	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-15,6827%	0,2902%	0,9974	21,4114%	0,56%	69.952.957,42	252
28	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-15,7278%	0,3298%	1,0004	21,4610%	0,30%	49.184.530,02	252
29	SANTANDER FI IBRX ACOES	-15,7705%	0,2079%	0,9976	21,4030%	0,10%	523.411.478,15	252
30	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-16,4754%	-1,1138%	0,9762	21,0795%	0,35%	7.737.468,39	252
31	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-16,9943%	-1,0399%	0,9967	21,3917%	0,09%	359.505.608,51	252
32	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-17,0758%	-1,1554%	0,9955	21,3671%	0,01%	359.780.523,08	252
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-17,2713%	-1,7294%	0,9815	22,2961%	1,85%	161.215.265,59	252
	MÉDIA:	-14,7860%	0,7629%	0,9829	21,2313%		209.506.605,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/03/2023
 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

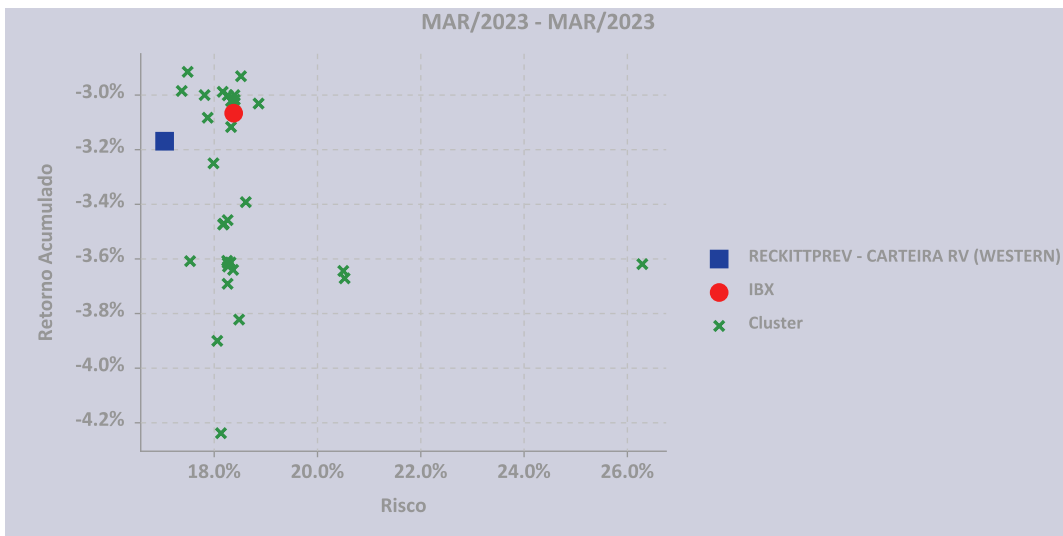
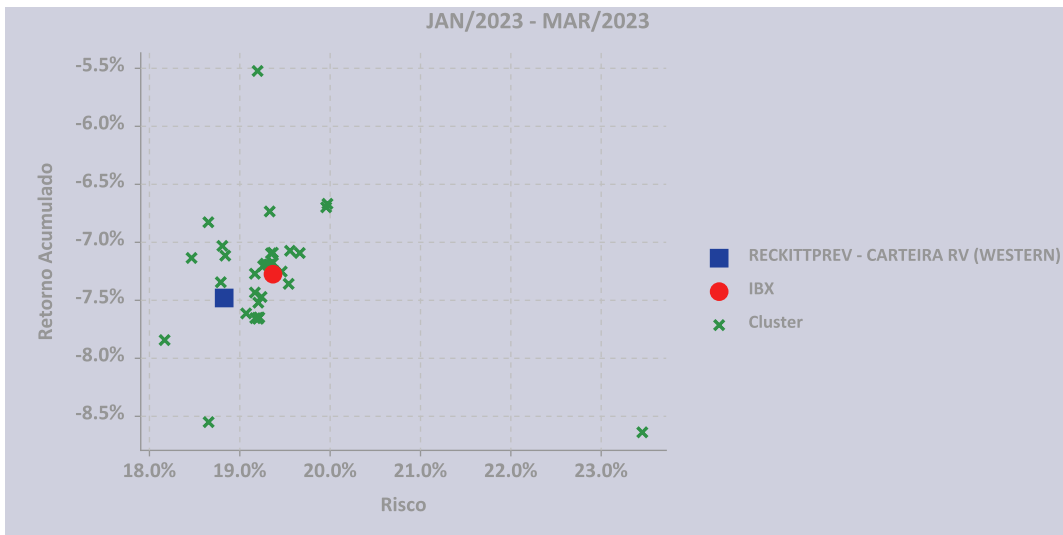
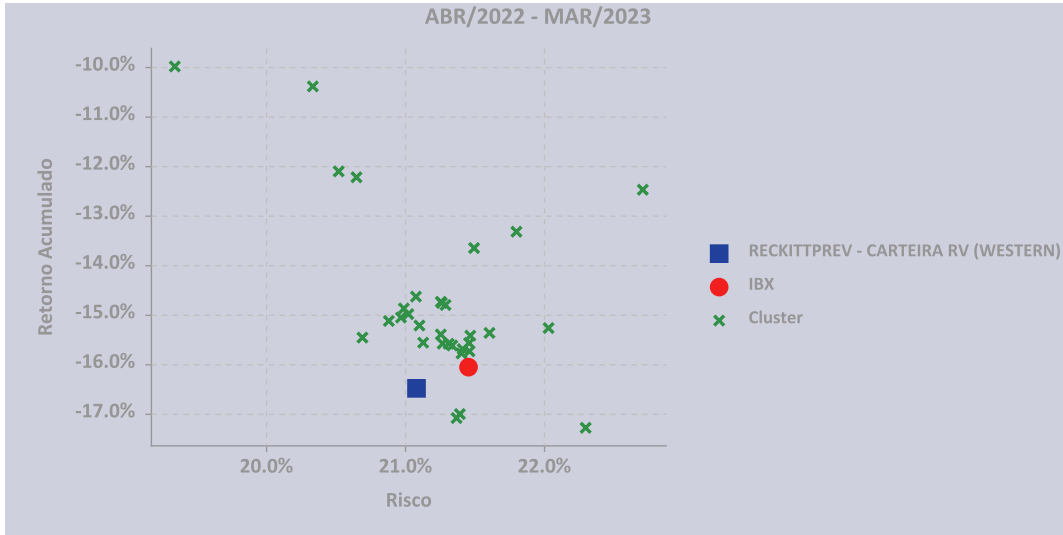
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,5232%	1,3608%	0,9481	19,1976%	1,85%	161.215.265,59	63
2	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-6,6685%	0,7304%	1,0162	19,9707%	2,00%	342.080.699,64	63
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-6,6988%	0,6923%	1,0151	19,9562%	2,00%	277.209.291,77	63
4	IAJA ACOES FC FIA	-6,7346%	0,4447%	0,9880	19,3317%	0,08%	199.400.889,34	63
5	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-6,8275%	0,0577%	0,9629	18,6529%	0,30%	33.884.992,32	63
6	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-7,0312%	-0,0637%	0,9710	18,8074%	0,00%	204.192.106,59	63
7	IAJA SAM ACOES FI	-7,0731%	0,2474%	1,0001	19,5562%	0,22%	126.139.505,95	63
8	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-7,0907%	0,1836%	1,0000	19,3668%	0,00%	1.042.412.041,51	63
9	MULTIPREV FIA	-7,0927%	0,3191%	1,0137	19,6644%	0,00%	662.577.249,27	63
10	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-7,0959%	0,1667%	0,9995	19,3455%	0,15%	168.832.687,45	63
11	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-7,1155%	-0,1326%	0,9717	18,8397%	0,00%	64.919.037,23	63
12	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-7,1354%	-0,3554%	0,9522	18,4663%	0,75%	34.008.147,14	63
13	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-7,1764%	0,0986%	1,0001	19,3679%	0,30%	49.184.530,02	63
14	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-7,1846%	0,0444%	0,9954	19,2840%	0,15%	125.820.536,36	63
15	SANTANDER FI IBRX ACOES	-7,1911%	0,0629%	0,9980	19,3293%	0,10%	523.411.478,15	63
16	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-7,1967%	0,0486%	0,9972	19,3134%	0,19%	25.485.164,24	63
17	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-7,2043%	0,0088%	0,9932	19,2586%	0,56%	69.952.957,42	63
18	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-7,2528%	0,0727%	1,0064	19,4647%	0,00%	170.722.247,32	63
19	COMSHELL CONCHA FIA	-7,2720%	-0,1064%	0,9882	19,1675%	0,17%	64.288.400,74	63
20	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-7,3446%	-0,4092%	0,9686	18,7902%	0,15%	61.290.793,18	63
21	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-7,3590%	-0,0023%	1,0097	19,5413%	0,70%	28.484.803,34	63
22	BRAM FIA IBRX ATIVO	-7,4331%	-0,2726%	0,9885	19,1674%	0,00%	385.929.432,63	63
23	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-7,4717%	-0,2712%	0,9922	19,2415%	0,00%	122.967.854,08	63
24	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-7,4803%	-0,6766%	0,9477	18,8277%	0,35%	7.737.468,39	63
25	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-7,5202%	-0,3386%	0,9905	19,2056%	0,00%	346.868.513,75	63
26	BRADESCO FIA SALUBRE	-7,6131%	-0,5054%	0,9838	19,0701%	0,50%	122.683.817,42	63
27	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-7,6483%	-0,4640%	0,9922	19,2165%	0,09%	359.505.608,51	63
28	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-7,6518%	-0,4748%	0,9903	19,1964%	0,70%	11.029.073,87	63
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-7,6548%	-0,4920%	0,9888	19,1716%	0,90%	196.396.128,76	63
30	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-7,6595%	-0,4819%	0,9916	19,2039%	0,01%	359.780.523,08	63
31	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-7,8438%	-1,4336%	0,9201	18,1686%	0,41%	403.598.474,71	63
32	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-8,5507%	-1,8788%	0,9483	18,6552%	0,75%	79.877.509,85	63
33	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-8,6387%	0,0579%	1,1501	23,4551%	1,70%	81.830.756,36	63
	MÉDIA:	-7,2859%	-0,1140%	0,9903	19,3107%		209.506.605,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/03/2023
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	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-2,9157%	-0,0551%	0,9520	17,4864%	0,30%	33.884.992,32	23
2	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-2,9312%	0,1676%	1,0081	18,5193%	0,00%	170.722.247,32	23
3	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,9856%	-0,1540%	0,9452	17,3713%	0,75%	34.008.147,14	23
4	COMSHELL CONCHA FIA	-2,9889%	0,0283%	0,9884	18,1644%	0,17%	64.288.400,74	23
5	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-3,0001%	-0,0663%	0,9693	17,8141%	0,00%	64.919.037,23	23
6	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-3,0005%	0,0694%	1,0008	18,3924%	0,00%	1.042.412.041,51	23
7	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-3,0018%	0,0377%	0,9932	18,2623%	0,15%	125.820.536,36	23
8	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-3,0175%	0,0539%	1,0011	18,3987%	0,15%	168.832.687,45	23
9	SANTANDER FI IBRX ACOES	-3,0199%	0,0425%	0,9990	18,3603%	0,10%	523.411.478,15	23
10	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-3,0224%	0,0321%	0,9970	18,3259%	0,19%	25.485.164,24	23
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-3,0309%	0,0397%	1,0009	18,3953%	0,30%	49.184.530,02	23
12	MULTIPREV FIA	-3,0314%	0,1292%	1,0234	18,8593%	0,00%	662.577.249,27	23
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-3,0840%	-0,1348%	0,9728	17,8749%	0,00%	204.192.106,59	23
14	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-3,1176%	-0,0648%	0,9965	18,3262%	0,56%	69.952.957,42	23
15	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-3,1697%	-0,4374%	0,9213	17,0405%	0,35%	7.737.468,39	23
16	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-3,2502%	-0,2846%	0,9780	17,9861%	0,15%	61.290.793,18	23
17	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,3928%	-0,2790%	1,0147	18,6127%	0,70%	28.484.803,34	23
18	IAJA ACOES FC FIA	-3,4587%	-0,4529%	0,9896	18,2607%	0,08%	199.400.889,34	23
19	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-3,4711%	-0,4546%	0,9900	18,1868%	0,09%	359.505.608,51	23
20	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-3,4748%	-0,4617%	0,9892	18,1725%	0,01%	359.780.523,08	23
21	BRAM FIA IBRX ATIVO	-3,6079%	-0,5743%	0,9923	18,2515%	0,00%	385.929.432,63	23
22	DAHLIA ACOES FC FIA	-3,6085%	-0,8493%	0,9283	17,5337%	1,85%	161.215.265,59	23
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-3,6140%	-0,5649%	0,9957	18,3173%	0,00%	346.868.513,75	23
24	BRADESCO FIA SALUBRE	-3,6151%	-0,5790%	0,9930	18,2606%	0,50%	122.683.817,42	23
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-3,6195%	0,7551%	1,3214	26,2894%	1,70%	81.830.756,36	23
26	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-3,6289%	-0,5911%	0,9933	18,2679%	0,70%	11.029.073,87	23
27	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-3,6400%	-0,5801%	0,9982	18,3662%	0,00%	122.967.854,08	23
28	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-3,6442%	-0,2367%	1,0848	20,4999%	2,00%	342.080.699,64	23
29	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,6714%	-0,2585%	1,0861	20,5257%	2,00%	277.209.291,77	23
30	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-3,6914%	-0,6559%	0,9928	18,2596%	0,90%	196.396.128,76	23
31	IAJA SAM ACOES FI	-3,8225%	-0,7456%	1,0045	18,4821%	0,22%	126.139.505,95	23
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-3,9008%	-1,0274%	0,9616	18,0599%	0,41%	403.598.474,71	23
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-4,2381%	-1,3804%	0,9600	18,1311%	0,75%	79.877.509,85	23
	MÉDIA:	-3,3536%	-0,2889%	1,0013	18,5471%		209.506.605,64	

MAPA DE RISCO X RETORNO





Agrupamento: -.-
MULTIMERCADOS

Março/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: 1,82235
 PATRIMÔNIO: 17.109.863,92

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	91,62%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	1,42%
IDIV	0,00%	IRF-M	4,81%
IMA B 5	2,12%	IMA B 5+	0,04%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 32,81%

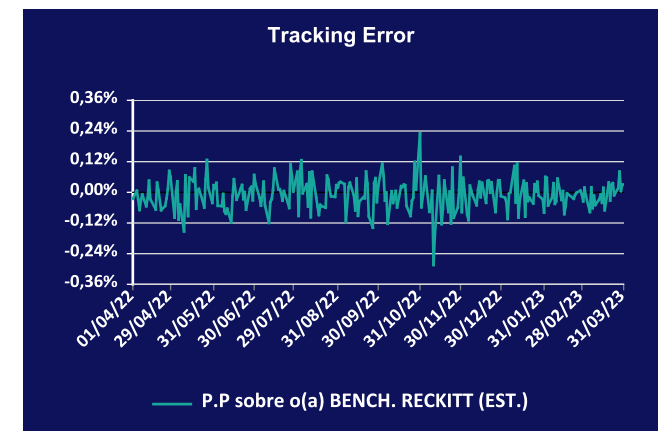
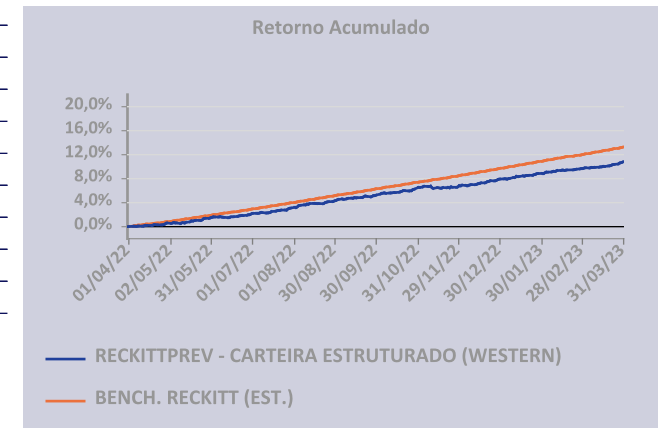
SELEÇÃO: 67,19%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0086%	--
RETORNO ACUMULADO	10,8354%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,2872%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,4517%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0161	--
SHARPE	-0,1419	--
SORTINO	-0,1786	--
STERLING RATIO	-0,1704	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,6300	--
DOWNSIDE RISK	0,0485%	--
RISCO ATIVO	0,0610%	--
RISCO TOTAL	0,0611%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,9710%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (EST.)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (EST.)	10
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	1,05%	2,69%	10,84%	14,50%	23,22%	0,28% (31/10/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 1,82235
 PATRIMÔNIO: 17.109.863,92

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,48%	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+	0,52%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 0,31%

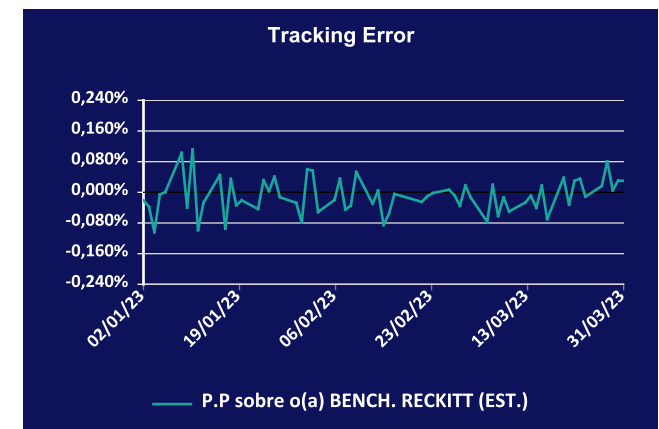
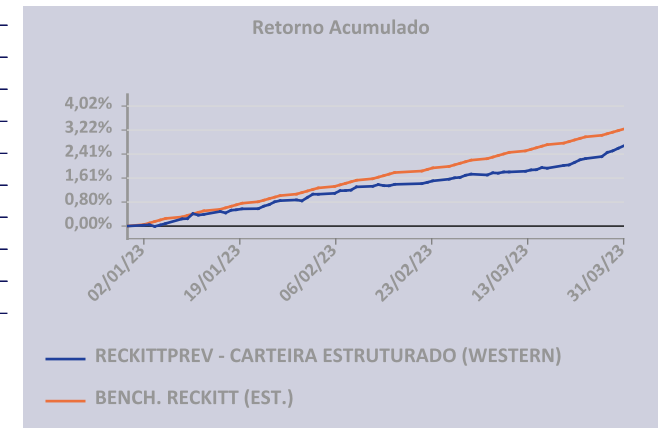
SELEÇÃO: 99,69%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0086%	--
RETORNO ACUMULADO	2,6877%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2505%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5628%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0839	--
SHARPE	-0,1868	--
SORTINO	-0,2362	--
STERLING RATIO	-0,2879	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,9199	--
DOWNSIDE RISK	0,0367%	--
RISCO ATIVO	0,0464%	--
RISCO TOTAL	0,0464%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7367%	--

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	1,0544%(03/2023)
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	1,05%	2,69%	10,84%	14,50%	23,22%	0,16% (11/01/2023)	-0,05% (04/01/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	2,12% (17/01/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,36% (15/02/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 1,82235
 PATRIMÔNIO: 17.109.863,92

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,56%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,44%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 1,09%

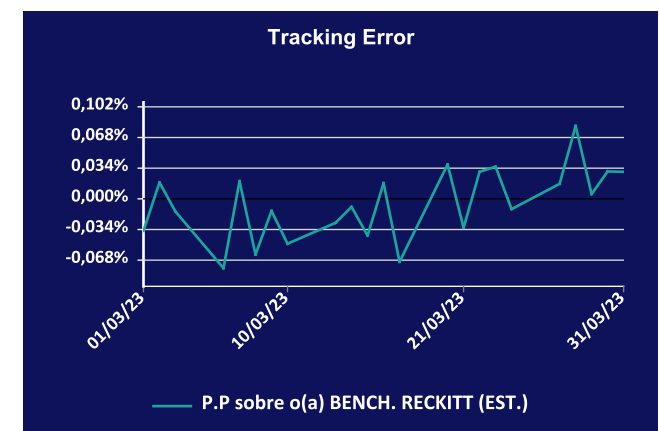
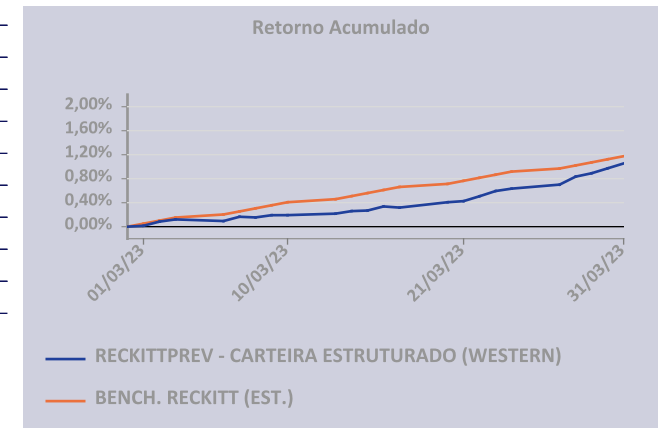
SELEÇÃO: 98,91%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0051%	--
RETORNO ACUMULADO	1,0544%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1746%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1202%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,1510	--
SHARPE	-0,1295	--
SORTINO	-0,1658	--
STERLING RATIO	-0,2753	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,2016	--
DOWNSIDE RISK	0,0311%	--
RISCO ATIVO	0,0398%	--
RISCO TOTAL	0,0398%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,6330%	--

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	1,0544%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,0544%(03/2023)



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	1,05%	2,69%	10,84%	14,50%	23,22%	0,13% (28/03/2023)	-0,03% (06/03/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	1,69% (30/03/2023)	-1,63% (17/03/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,38% (09/03/2023)	-0,15% (02/03/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,26% (13/03/2023)	-0,14% (28/03/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	0,81% (09/03/2023)	-0,46% (02/03/2023)
IMA-GERAL	1,86%	3,63%	10,83%	16,27%	22,06%	0,28% (09/03/2023)	-0,11% (02/03/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	1,18% (15/03/2023)	-1,16% (27/03/2023)



*Agrupamento: -.-
INVEST. NO EXTERIOR*

Março/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: 2,70932
 PATRIMÔNIO: 9.911.203,23

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	67,61%
DÓLAR PTAX	32,39%		

ESTILO: 61,59%

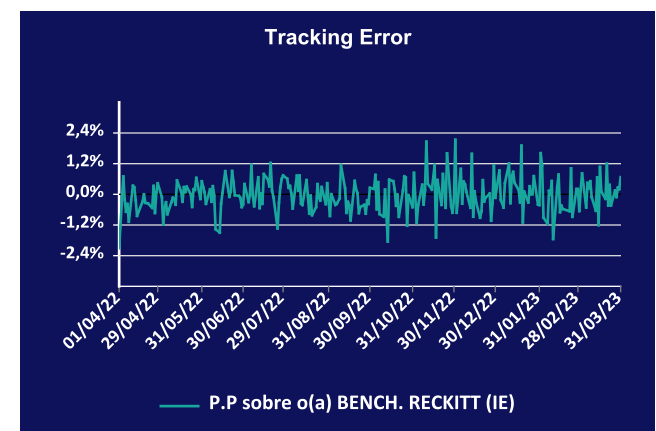
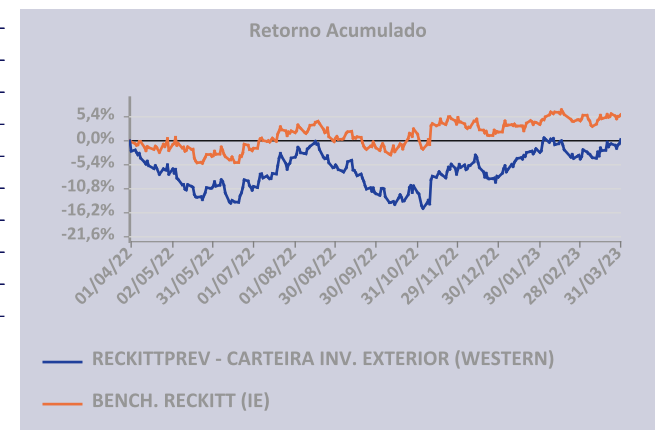
SELEÇÃO: 38,41%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0426%	--
RETORNO ACUMULADO	0,2874%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	5,8699%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-5,5824%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0026	--
SHARPE	-0,0397	--
SORTINO	-0,0573	--
STERLING RATIO	-0,0277	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,7148	--
DOWNSIDE RISK	0,7437%	--
RISCO ATIVO	0,6677%	--
RISCO TOTAL	1,0732%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,0375%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	5
MESES NEGATIVOS	7
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	5
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	7
MAIOR RETORNO MENSAL	8,1428%(07/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,5309%(04/2022)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	3,66%	9,24%	0,29%	-7,33%	27,99%	6,32% (10/11/2022)	-3,00% (03/11/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	1,11%	3,83%	5,87%	6,86%	41,37%	4,26% (10/11/2022)	-2,68% (29/04/2022)
MSCI EUROPE	1,96%	9,89%	-1,27%	-0,11%	41,84%	4,58% (04/10/2022)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	2,83%	7,25%	-8,57%	-0,72%	50,67%	5,05% (10/11/2022)	-3,66% (13/09/2022)
DÓLAR D2	-2,81%	-3,99%	6,95%	-10,05%	-2,23%	4,38% (22/04/2022)	-3,87% (03/10/2022)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)
EURO PTAX	0,00%	-0,81%	5,10%	-17,44%	-3,53%	4,34% (10/11/2022)	-3,57% (03/10/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,32%	4,43%	-1,96%	-11,47%	47,24%	7,97% (10/11/2022)	-4,10% (29/04/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,06%	2,98%	-2,21%	-10,70%	47,31%	8,97% (10/11/2022)	-3,74% (26/08/2022)
S&P 500	3,51%	7,03%	-9,29%	3,43%	58,99%	5,54% (10/11/2022)	-4,32% (13/09/2022)
S&P 500 BRL PTAX	0,97%	4,21%	-2,74%	-7,77%	55,37%	8,48% (10/11/2022)	-5,40% (29/04/2022)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

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: 2,70932
 PATRIMÔNIO: 9.911.203,23

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	78,00%
DÓLAR PTAX	21,99%		

ESTILO: 56,30%

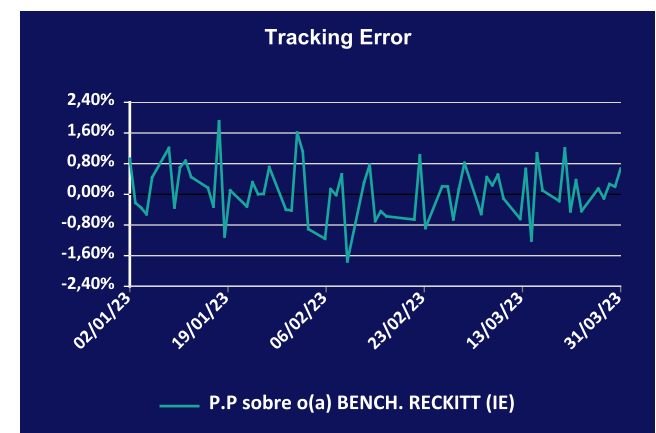
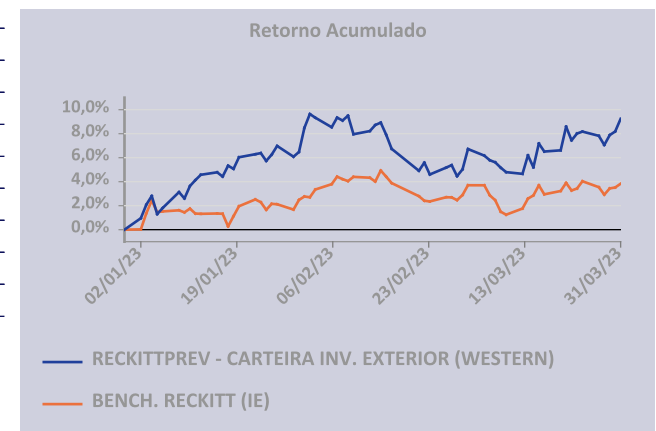
SELEÇÃO: 43,70%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0930%	--
RETORNO ACUMULADO	9,2376%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,8281%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	5,4094%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0160	--
SHARPE	0,1100	--
SORTINO	0,1716	--
STERLING RATIO	0,0833	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,8891	--
DOWNSIDE RISK	0,5421%	--
RISCO ATIVO	0,7118%	--
RISCO TOTAL	0,8454%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,4213%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	6,4745%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,0319%(02/2023)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	3,66%	9,24%	0,29%	-7,33%	27,99%	1,89% (01/02/2023)	-1,71% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	1,11%	3,83%	5,87%	6,86%	41,37%	1,34% (03/01/2023)	-1,05% (22/02/2023)
MSCI EUROPE	1,96%	9,89%	-1,27%	-0,11%	41,84%	2,16% (09/01/2023)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	2,83%	7,25%	-8,57%	-0,72%	50,67%	2,12% (06/01/2023)	-1,54% (21/02/2023)
DÓLAR D2	-2,81%	-3,99%	6,95%	-10,05%	-2,23%	2,21% (03/02/2023)	-2,22% (06/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)
EURO PTAX	0,00%	-0,81%	5,10%	-17,44%	-3,53%	2,31% (02/01/2023)	-1,57% (05/01/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,32%	4,43%	-1,96%	-11,47%	47,24%	2,59% (02/01/2023)	-2,30% (22/02/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,06%	2,98%	-2,21%	-10,70%	47,31%	1,78% (23/03/2023)	-2,70% (05/01/2023)
S&P 500	3,51%	7,03%	-9,29%	3,43%	58,99%	2,28% (06/01/2023)	-2,16% (22/02/2023)
S&P 500 BRL PTAX	0,97%	4,21%	-2,74%	-7,77%	55,37%	2,62% (03/01/2023)	-2,16% (22/02/2023)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

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: 2,70932
 PATRIMÔNIO: 9.911.203,23

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	31,78%	MSCI WORLD	45,46%
DÓLAR PTAX	22,76%		

ESTILO: 68,53%

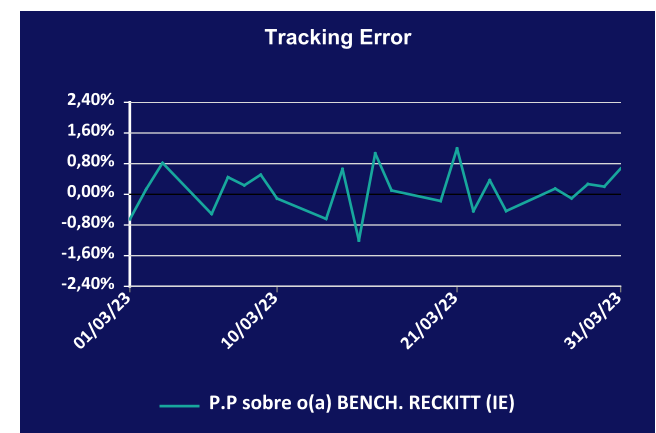
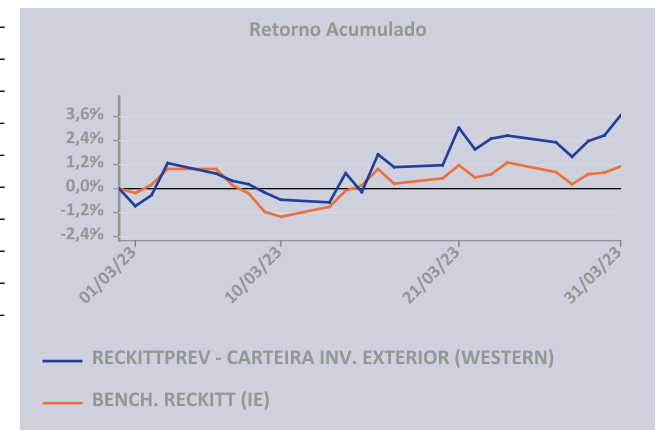
SELEÇÃO: 31,47%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,1096%	--
RETORNO ACUMULADO	3,6648%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1085%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	2,5562%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0383	--
SHARPE	0,1217	--
SORTINO	0,2314	--
STERLING RATIO	0,1004	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,4126	--
DOWNSIDE RISK	0,4739%	--
RISCO ATIVO	0,5896%	--
RISCO TOTAL	0,9008%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,3000%	--

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	3,6648%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	3,6648%(03/2023)



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	3,66%	9,24%	0,29%	-7,33%	27,99%	1,89% (16/03/2023)	-1,05% (22/03/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	1,11%	3,83%	5,87%	6,86%	41,37%	0,82% (16/03/2023)	-0,93% (09/03/2023)
MSCI EUROPE	1,96%	9,89%	-1,27%	-0,11%	41,84%	2,02% (16/03/2023)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	2,83%	7,25%	-8,57%	-0,72%	50,67%	1,50% (16/03/2023)	-1,44% (07/03/2023)
DÓLAR D2	-2,81%	-3,99%	6,95%	-10,05%	-2,23%	1,56% (10/03/2023)	-1,12% (08/03/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	1,18% (15/03/2023)	-1,16% (27/03/2023)
EURO PTAX	0,00%	-0,81%	5,10%	-17,44%	-3,53%	2,04% (10/03/2023)	-1,28% (08/03/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,32%	4,43%	-1,96%	-11,47%	47,24%	1,33% (16/03/2023)	-1,57% (07/03/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,06%	2,98%	-2,21%	-10,70%	47,31%	1,78% (23/03/2023)	-1,43% (22/03/2023)
S&P 500	3,51%	7,03%	-9,29%	3,43%	58,99%	1,76% (16/03/2023)	-1,85% (09/03/2023)
S&P 500 BRL PTAX	0,97%	4,21%	-2,74%	-7,77%	55,37%	1,59% (16/03/2023)	-1,91% (09/03/2023)

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)*

Março/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: 2,43732
 PATRIMÔNIO: 142.062.978,89

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	89,49%	IBX	5,75%
IVBX-2	0,63%	SMLL	2,91%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,21%

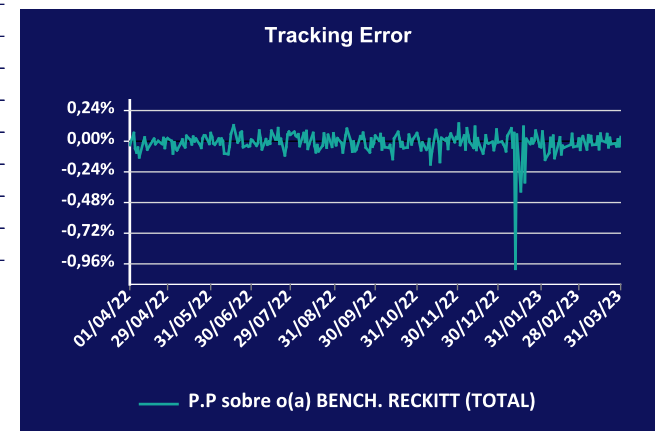
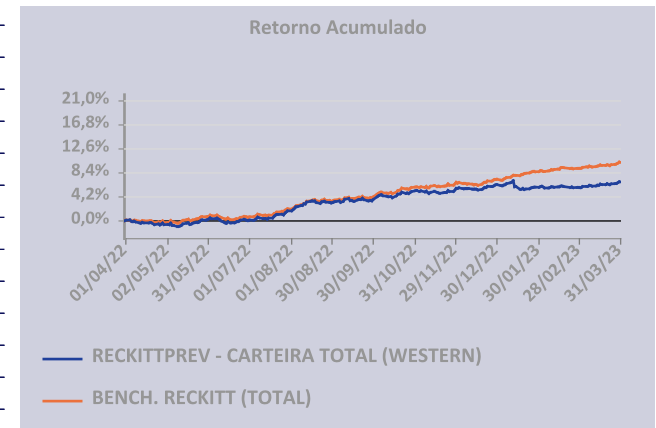
ESTILO: 62,74% | SELEÇÃO: 37,26%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0231%	--
RETORNO ACUMULADO	6,8270%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,2449%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,4179%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0104%	--
BETA	0,0909	--
MARKET TIMING	-0,1496	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5926	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	82,5027%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	48,9173%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,2372	--
JENSEN	-3,7841%	--
MODIGLIANI	-25,1864%	--
SHARPE	-0,1448	--
SORTINO	-0,1718	--
TREYNOR	-0,0025	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	63,6281	--
DOWNSIDE RISK	0,1349%	--
RISCO ATIVO	0,0884%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,4035%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1021%	--
RISCO TOTAL	0,1601%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,5420%	--

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	0,89%	0,45%	6,83%	9,23%	26,24%	0,48% (03/10/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	2,74%	10,24%	16,55%	32,96%	0,48% (03/10/2022)	-0,33% (05/05/2022)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (01/04/2022)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 2,43732
 PATRIMÔNIO: 142.062.978,89

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	92,77%	IBX	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	6,04%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,19%

ESTILO: 26,91%

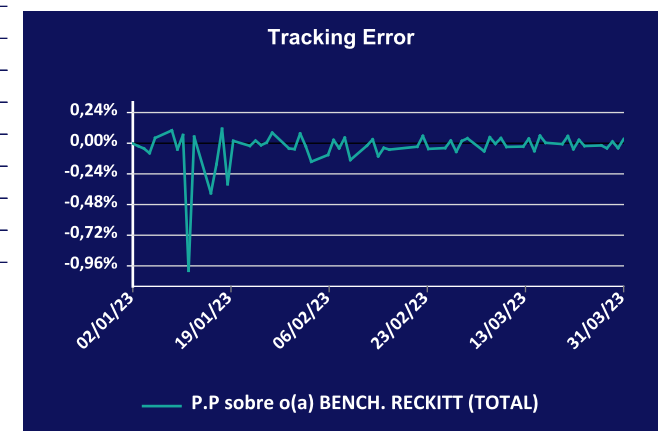
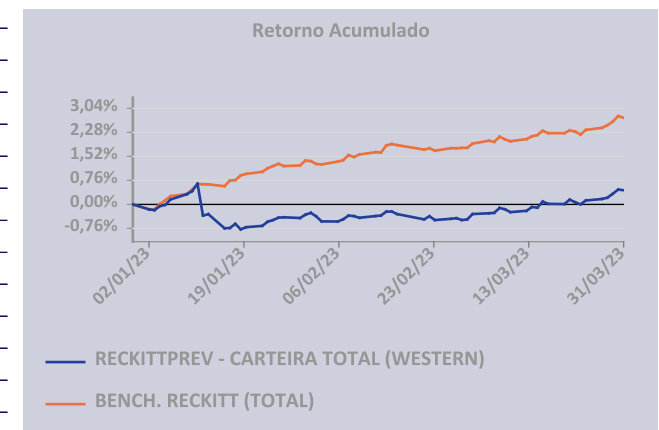
SELEÇÃO: 73,09%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0435%	--
RETORNO ACUMULADO	0,4499%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,7429%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,2930%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0320%	--
BETA	0,0628	--
MARKET TIMING	-0,0783	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,2031	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	77,1405%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9617%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	5,0860%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-3,8206	--
JENSEN	-2,1366%	--
MODIGLIANI	-9,4835%	--
SHARPE	-0,2548	--
SORTINO	-0,2607	--
TREYNOR	-0,0068	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	28,8346	--
DOWNSIDE RISK	0,1669%	--
RISCO ATIVO	0,1484%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,3566%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1524%	--
RISCO TOTAL	0,1707%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,7108%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	3
MAIOR RETORNO MENSAL	0,8916%(03/2023)
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	0,89%	0,45%	6,83%	9,23%	26,24%	0,23% (11/01/2023)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	2,74%	10,24%	16,55%	32,96%	0,22% (15/02/2023)	-0,15% (02/01/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	2,12% (17/01/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,36% (15/02/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	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: 2,43732
 PATRIMÔNIO: 142.062.978,89

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	92,94%	IBX	5,13%
IVBX-2	0,55%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,30%	DÓLAR PTAX	0,08%

ESTILO: 56,13%

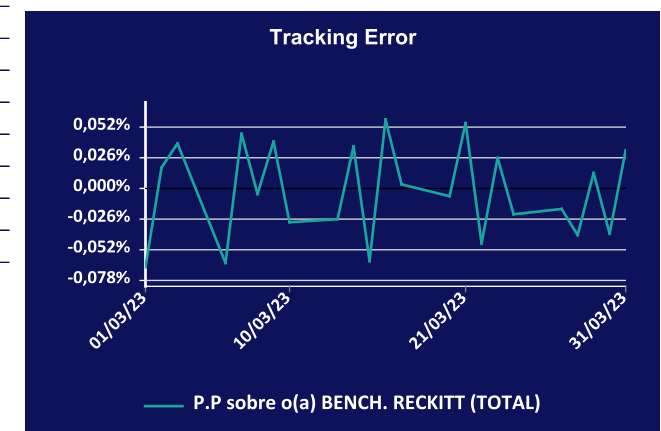
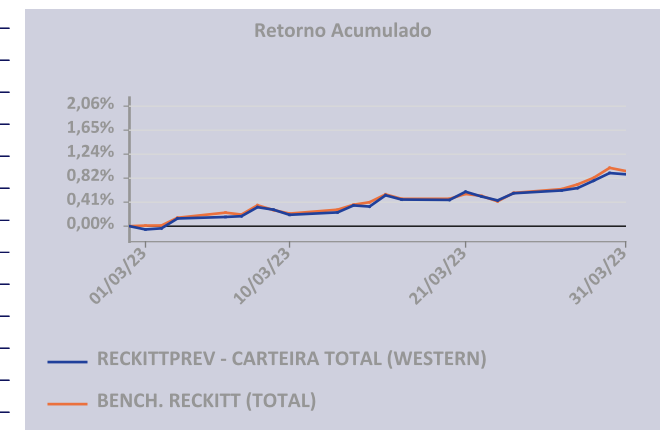
SELEÇÃO: 43,87%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0121%	--
RETORNO ACUMULADO	0,8916%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9476%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0560%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0058%	--
BETA	0,0563	--
MARKET TIMING	-0,6010	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5698	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	26,6098%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9927%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	50,2913%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,9619	--
JENSEN	-0,0399%	--
MODIGLIANI	0,5477%	--
SHARPE	-0,1369	--
SORTINO	-0,1822	--
TREYNOR	-0,0021	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,6014	--
DOWNSIDE RISK	0,0666%	--
RISCO ATIVO	0,0397%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,6313%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0588%	--
RISCO TOTAL	0,0887%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4084%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,8916%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,8916%(03/2023)



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	0,89%	0,45%	6,83%	9,23%	26,24%	0,19% (16/03/2023)	-0,09% (10/03/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	2,74%	10,24%	16,55%	32,96%	0,17% (30/03/2023)	-0,09% (23/03/2023)
CDI	1,17%	3,25%	13,29%	20,59%	23,27%	0,05% (13/03/2023)	0,05% (28/03/2023)
IBOVESPA	-2,91%	-7,16%	-15,10%	-12,65%	39,53%	2,22% (08/03/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	-3,07%	-7,27%	-16,05%	-13,70%	39,95%	2,14% (08/03/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	-3,52%	-8,44%	-25,48%	-30,61%	9,96%	2,83% (08/03/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMLL	-1,74%	-9,51%	-27,95%	-35,01%	6,96%	3,08% (08/03/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	-2,02%	-4,08%	-6,43%	4,48%	45,59%	1,69% (30/03/2023)	-1,63% (17/03/2023)
IRF-M	2,15%	3,89%	11,55%	13,99%	16,56%	0,38% (09/03/2023)	-0,15% (02/03/2023)
IMA B 5	1,52%	4,38%	10,38%	20,01%	30,21%	0,26% (13/03/2023)	-0,14% (28/03/2023)
IMA B 5+	3,73%	3,61%	5,03%	5,39%	18,05%	0,81% (09/03/2023)	-0,46% (02/03/2023)
DÓLAR PTAX	-2,45%	-2,63%	7,23%	-10,83%	-2,28%	1,18% (15/03/2023)	-1,16% (27/03/2023)