

pps *portfolio
performance*

Avaliação de Performance: RECKITT PREV

Abril/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 11,34%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 9,03%, 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 não agradou. O retorno acumulado, pouco abaixo do “benchmark” proposto, foi o 26º colocado entre 33 possibilidades. O risco total e o beta figuraram abaixo da mediana da amostra; contrapondo-se ao risco diversificável. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, se mostraram negativos e modestos. Em abril, há indícios de insucesso na seleção dos ativos, alfa obtido com baixa significância estatística, e em “timing”. O histórico dos últimos doze meses, bem como o de períodos mais longos, também 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. Em mais uma ocasião, é possível constatar que 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 apresentou sensível melhora e passou a figurar acima do índice de referência (“benchmark”) estabelecido em sua Política de Investimentos. O desempenho mensal, a despeito da modesta valorização, também atendeu às expectativas. Em linhas gerais, 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 desagradou, uma vez que seu rendimento não foi capaz de atender ao “benchmark” proposto. 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. Sendo assim, sugere-se que a Reckitt Prev acompanhe de perto as providências que o gestor irá desenvolver para tentar reverter este quadro. Reitera-se que a Entidade tem avançado em algumas discussões com o intuito de promover as mudanças, anteriormente citadas, preservando a diversificação de seus investimentos.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – ABRIL DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	29.402.963,47	17,02%
Renda Fixa (Ativa)	109.772.819,50	63,55%
Renda Variável	8.318.777,01	4,82%
Estruturado	16.051.316,20	9,29%
Exterior	9.194.707,85	5,32%
Total	172.740.584,03	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)*

Abril/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: 5,25241
 PATRIMÔNIO: 29.402.963,47

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,40%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	1,33%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,26%

ESTILO: 1,21%

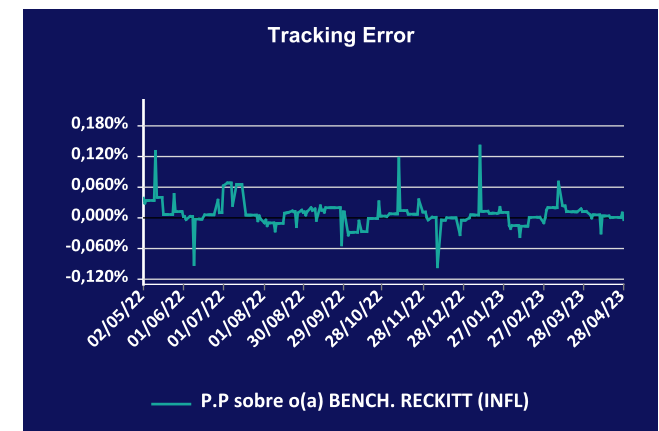
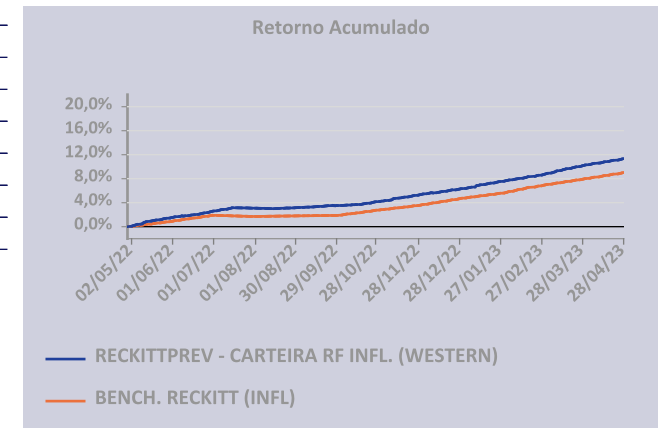
SELEÇÃO: 98,79%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0072%	--
RETORNO ACUMULADO	11,3448%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	9,0260%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	2,3187%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,2546	--
SORTINO	-0,2963	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	10,9042	--
DOWNSIDE RISK	0,0243%	--
RISCO ATIVO	0,0249%	--
RISCO TOTAL	0,0281%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4463%	--

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	1,4889%(05/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	0,0760%(08/2022)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,96%	4,71%	11,34%	31,12%	46,56%	0,18% (10/01/2023)	-0,05% (28/09/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,94%	4,10%	9,03%	28,75%	45,45%	0,07% (01/02/2023)	-0,01% (26/07/2022)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,05% (01/02/2023)	-0,03% (06/07/2022)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,04% (01/02/2023)	-0,03% (01/07/2022)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,78% (10/11/2022)	-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: 5,25241
 PATRIMÔNIO: 29.402.963,47

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,80%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,20%

ESTILO: 1,88%

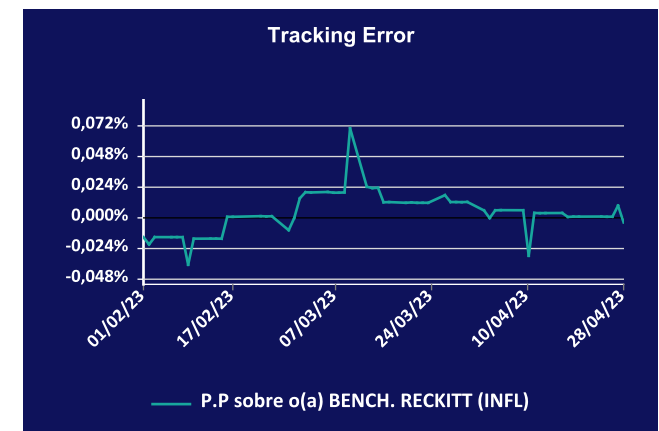
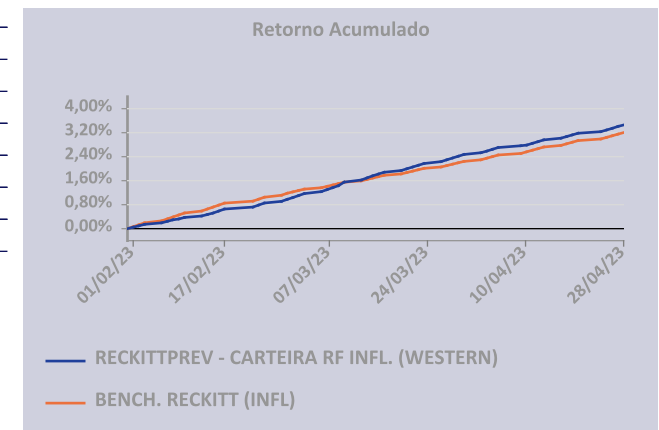
SELEÇÃO: 98,12%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0068%	--
RETORNO ACUMULADO	3,4577%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2036%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,2541%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,5931	--
SORTINO	1,4223	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,1949	--
DOWNSIDE RISK	0,0048%	--
RISCO ATIVO	0,0162%	--
RISCO TOTAL	0,0115%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1831%	--

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	0,9605%(04/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,96%	4,71%	11,34%	31,12%	46,56%	0,12% (10/03/2023)	0,02% (11/04/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,94%	4,10%	9,03%	28,75%	45,45%	0,07% (01/02/2023)	0,05% (01/03/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	0,78% (15/02/2023)	-0,48% (03/02/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,05% (01/02/2023)	0,03% (01/03/2023)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,04% (01/02/2023)	0,03% (01/03/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)

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: 5,25241
 PATRIMÔNIO: 29.402.963,47

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,65%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,35%

ESTILO: 9,40%

SELEÇÃO: 90,60%

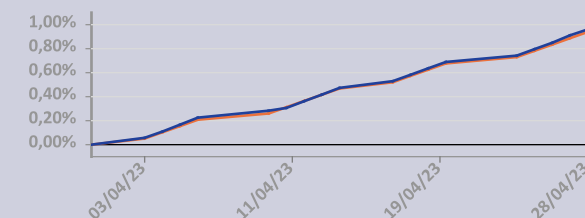
DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0023%	--
RETORNO ACUMULADO	0,9604%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9395%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0209%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,2819	--
SORTINO	0,3464	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	10,7699	--
DOWNSIDE RISK	0,0067%	--
RISCO ATIVO	0,0082%	--
RISCO TOTAL	0,0082%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1313%	--

PERFIL DE RETORNOS

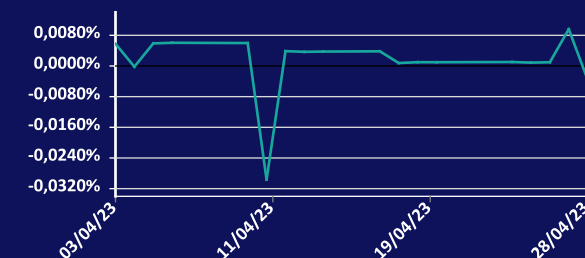
MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9605%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9605%(04/2023)

Retorno Acumulado



RECKITTPREV - CARTEIRA RF INFL. (WESTERN)
 BENCH. RECKITT (INFL)

Tracking Error



P.P sobre o(a) BENCH. RECKITT (INFL)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,96%	4,71%	11,34%	31,12%	46,56%	0,06% (27/04/2023)	0,02% (11/04/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,94%	4,10%	9,03%	28,75%	45,45%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (03/04/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,05% (06/04/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	0,47% (13/04/2023)	-0,36% (19/04/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,21% (11/04/2023)	-0,10% (28/04/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,27% (11/04/2023)	-0,16% (19/04/2023)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,03% (03/04/2023)	0,03% (03/04/2023)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,03% (03/04/2023)	0,03% (03/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)



Agrupamento: Renda Fixa
ÍNDICES (PPS)

Abril/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: 2,92695
 PATRIMÔNIO: 109.772.819,50

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	78,64%	IRF-M	10,60%
IMA B 5	9,57%	IMA B 5+	0,78%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,41%

ESTILO: 13,08%

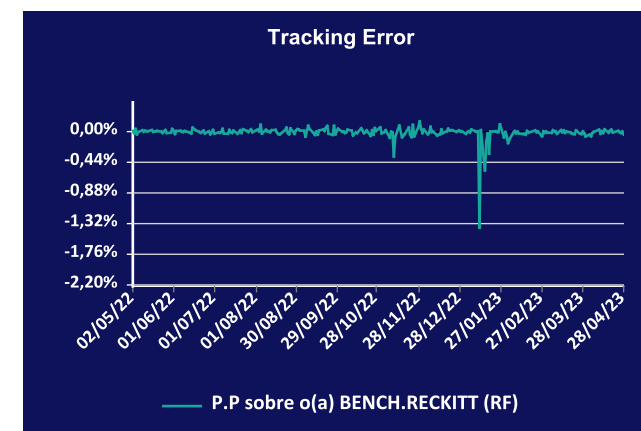
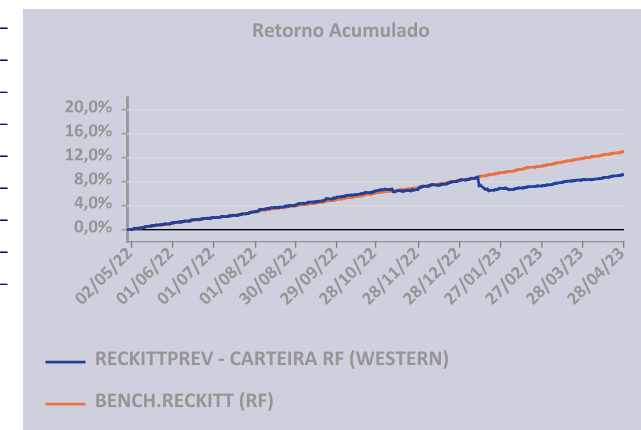
SELEÇÃO: 86,92%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0151%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	9,1364%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,0082%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,8717%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,1029	9° de 15
SHARPE	-0,1395	15° de 15
SORTINO	-0,1444	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	119,8006	--
DOWNSIDE RISK	0,1048%	3° de 15
RISCO ATIVO	0,1044%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1084%	5° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7218%	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	0,75%	0,78%	9,14%	15,84%	20,58%	0,24% (29/11/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,92%	4,31%	13,01%	22,52%	27,67%	0,10% (04/08/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,05% (01/02/2023)	-0,03% (06/07/2022)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,04% (01/02/2023)	-0,03% (01/07/2022)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,78% (10/11/2022)	-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: 2,92695
 PATRIMÔNIO: 109.772.819,50

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	83,81%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	15,50%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,70%

ESTILO: 28,21%

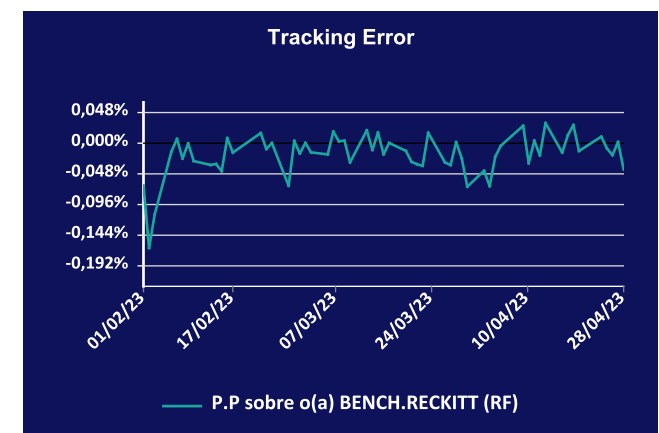
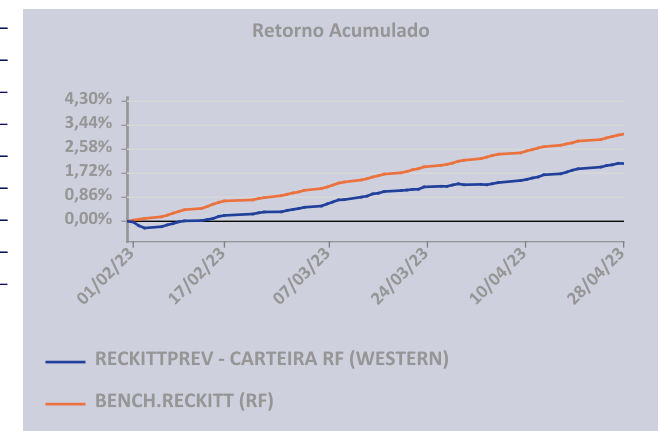
SELEÇÃO: 71,79%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0160%	15° de 15
RETORNO ACUMULADO	2,0705%	15° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1245%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,0539%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-8,3210	12° de 15
SHARPE	-0,4252	15° de 15
SORTINO	-0,4097	15° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	8,2211	--
DOWNSIDE RISK	0,0391%	9° de 15
RISCO ATIVO	0,0332%	5° de 15
RISCO TOTAL	0,0377%	14° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,5987%	14° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	3
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9159%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,3902%(02/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,75%	0,78%	9,14%	15,84%	20,58%	0,09% (13/03/2023)	-0,13% (02/02/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,92%	4,31%	13,01%	22,52%	27,67%	0,08% (15/02/2023)	0,03% (03/02/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,06% (01/03/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	0,78% (15/02/2023)	-0,48% (03/02/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,05% (01/02/2023)	0,03% (01/03/2023)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,04% (01/02/2023)	0,03% (01/03/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)

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: 2,92695
 PATRIMÔNIO: 109.772.819,50

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	96,20%	IRF-M	2,45%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,34%

ESTILO: 10,57%

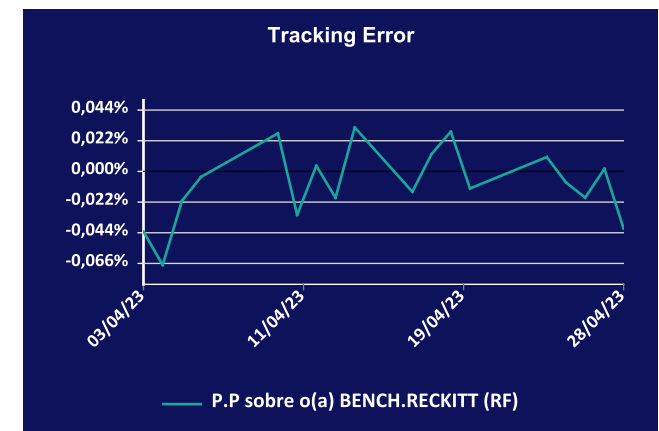
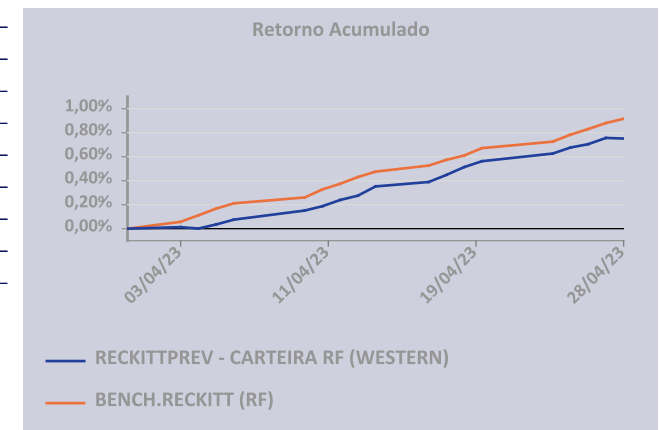
SELEÇÃO: 89,43%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0092%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,7511%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9166%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1654%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-5,4559	12° de 15
SHARPE	-0,3736	15° de 15
SORTINO	-0,3887	14° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,3423	--
DOWNSIDE RISK	0,0236%	13° de 15
RISCO ATIVO	0,0265%	6° de 15
RISCO TOTAL	0,0246%	13° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,3910%	13° 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	0,7511%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7511%(04/2023)



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	0,75%	0,78%	9,14%	15,84%	20,58%	0,08% (14/04/2023)	-0,01% (04/04/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,92%	4,31%	13,01%	22,52%	27,67%	0,07% (11/04/2023)	0,04% (28/04/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA-S	0,86%	4,18%	13,61%	22,31%	24,31%	0,05% (06/04/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,02%	6,08%	8,78%	13,88%	24,89%	0,47% (13/04/2023)	-0,36% (19/04/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,21% (11/04/2023)	-0,10% (28/04/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,27% (11/04/2023)	-0,16% (19/04/2023)
IPCA	0,61%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%	0,03% (03/04/2023)	0,03% (03/04/2023)
INPC	0,53%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	0,03% (03/04/2023)	0,03% (03/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2022 A 28/04/2023
 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	1,3588	13,2425%	-0,0049	1,4362%	0,77%	94.430.830,41	251
2	CLIENTE V - BRADESCO	-0,5631	11,3432%	-0,0501	2,2582%	0,34%	258.411.042,55	251
3	CLIENTE V - SANTANDER	-0,6694	12,9631%	-0,0695	0,3357%	0,20%	619.170.359,40	251
4	CLIENTE V - ITAÚ	-1,0173	11,6143%	-0,0533	1,8462%	0,38%	313.046.717,74	251
5	CLIENTE X - ITAU	-1,3241	11,7431%	-0,0722	1,2682%	0,13%	1.074.263.553,11	251
6	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-1,4722	11,6188%	-0,0700	1,4071%	0,10%	735.219.366,70	251
7	CLIENTE Y - BNP	-1,6674	11,2043%	-0,0983	1,2434%	0,16%	271.303.181,18	251
8	CLIENTE D - WESTERN	-1,7579	9,6651%	-0,1095	1,9141%	0,00%	248.199.430,13	251
9	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-2,1029	9,1365%	-0,1395	1,7219%	0,35%	109.772.819,50	251
10	CLIENTE Y - WESTERN	-2,3783	11,0204%	-0,1349	0,9845%	0,10%	271.379.937,94	251
11	CLIENTE X - BRADESCO	-2,3873	13,6561%	0,0299	0,5150%	0,13%	967.905.778,44	251
12	CLIENTE X - WESTERN	-2,3923	11,7163%	-0,0861	1,0823%	0,10%	935.344.365,12	251
13	CLIENTE V - WESTERN	-2,4931	7,6426%	-0,1340	2,4368%	0,38%	91.291.423,43	251
14	CLIENTE O - BRADESCO	-3,9161	13,3649%	-0,0016	0,5330%	0,18%	345.652.177,73	251
15	CLIENTE O - SANTANDER	-4,2504	11,5614%	-0,1394	0,7319%	0,18%	352.386.285,47	251
	MÉDIA:	-1,8022	11,4328%	-0,0756	1,3143%		445.851.817,92	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/04/2023
 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 Y - BNP	-0,1783	3,2762%	0,0705	0,8738%	0,16%	271.303.181,18	59
2	CLIENTE O - BRADESCO	-1,0793	3,1961%	0,0539	0,7543%	0,18%	345.652.177,73	59
3	CLIENTE V - BRADESCO	-1,4176	3,8451%	0,1481	1,4171%	0,34%	258.411.042,55	59
4	CLIENTE V - ITAÚ	-2,3035	3,7412%	0,1285	1,4232%	0,38%	313.046.717,74	59
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-2,3497	3,2323%	0,0632	0,7924%	0,10%	735.219.366,70	59
6	CLIENTE M - BAHIA	-2,5861	2,9209%	-0,0228	1,3545%	0,77%	94.430.830,41	59
7	CLIENTE X - ITAU	-2,7342	2,9897%	-0,0132	0,9914%	0,13%	1.074.263.553,11	59
8	CLIENTE X - WESTERN	-2,8981	2,5336%	-0,0956	1,3842%	0,10%	935.344.365,12	59
9	CLIENTE V - SANTANDER	-3,4706	2,9392%	-0,1007	0,2642%	0,20%	619.170.359,40	59
10	CLIENTE X - BRADESCO	-3,5286	3,2035%	0,0603	0,7055%	0,13%	967.905.778,44	59
11	CLIENTE D - WESTERN	-6,9718	2,9698%	-0,0148	1,2248%	0,00%	248.199.430,13	59
12	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-8,3211	2,0706%	-0,4252	0,5988%	0,35%	109.772.819,50	59
13	CLIENTE O - SANTANDER	-9,3046	2,4978%	-0,1915	0,7422%	0,18%	352.386.285,47	59
14	CLIENTE V - WESTERN	-9,9569	2,5542%	-0,0927	1,3693%	0,38%	91.291.423,43	59
15	CLIENTE Y - WESTERN	-12,0148	2,8231%	-0,0913	0,6231%	0,10%	271.379.937,94	59
	MÉDIA:	-4,6077	2,9862%	-0,0349	0,9679%		445.851.817,92	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/04/2023 A 28/04/2023
 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 O - BRADESCO	0,4021	0,8786%	-0,0521	0,6617%	0,18%	345.652.177,73	18
2	CLIENTE Y - BNP	-0,1759	0,9085%	-0,0111	0,7413%	0,16%	271.303.181,18	18
3	CLIENTE X - WESTERN	-0,6514	0,8624%	-0,0219	2,1658%	0,10%	935.344.365,12	18
4	CLIENTE V - BRADESCO	-1,7189	1,2069%	0,1858	1,3600%	0,34%	258.411.042,55	18
5	CLIENTE V - ITAÚ	-2,1347	1,1839%	0,1647	1,4131%	0,38%	313.046.717,74	18
6	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-2,1799	0,9177%	-0,0004	0,6265%	0,10%	735.219.366,70	18
7	CLIENTE X - ITAU	-2,2254	0,8232%	-0,0691	1,1968%	0,13%	1.074.263.553,11	18
8	CLIENTE D - WESTERN	-2,5922	1,0856%	0,1352	1,0850%	0,00%	248.199.430,13	18
9	CLIENTE V - SANTANDER	-3,3677	0,8805%	-0,1601	0,2054%	0,20%	619.170.359,40	18
10	CLIENTE X - BRADESCO	-4,2001	0,8734%	-0,0634	0,6145%	0,13%	967.905.778,44	18
11	CLIENTE M - BAHIA	-5,3490	0,8383%	-0,0893	0,7802%	0,77%	94.430.830,41	18
12	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-5,4559	0,7511%	-0,3736	0,3910%	0,35%	109.772.819,50	18
13	CLIENTE V - WESTERN	-6,6325	0,8762%	-0,0307	1,1794%	0,38%	91.291.423,43	18
14	CLIENTE O - SANTANDER	-6,6844	0,7387%	-0,3616	0,4341%	0,18%	352.386.285,47	18
15	CLIENTE Y - WESTERN	-11,7249	0,8291%	-0,2185	0,3565%	0,10%	271.379.937,94	18
	MÉDIA:	-3,6461	0,9103%	-0,0644	0,8807%		445.851.817,92	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2022 A 28/04/2023
 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	13,6561%	0,0299	0,0010%	0,5150%	0,13%	967.905.778,44	251
2	CLIENTE O - BRADESCO	13,3649%	-0,0016	-0,0001%	0,5330%	0,18%	345.652.177,73	251
3	CLIENTE M - BAHIA	13,2425%	-0,0049	-0,0004%	1,4362%	0,77%	94.430.830,41	251
4	CLIENTE V - SANTANDER	12,9631%	-0,0695	-0,0015%	0,3357%	0,20%	619.170.359,40	251
5	CLIENTE X - ITAU	11,7431%	-0,0722	-0,0058%	1,2682%	0,13%	1.074.263.553,11	251
6	CLIENTE X - WESTERN	11,7163%	-0,0861	-0,0059%	1,0823%	0,10%	935.344.365,12	251
7	CLIENTE X - BNP PARIBAS	11,6188%	-0,0700	-0,0062%	1,4071%	0,10%	735.219.366,70	251
8	CLIENTE V - ITAÚ	11,6143%	-0,0533	-0,0062%	1,8462%	0,38%	313.046.717,74	251
9	CLIENTE O - SANTANDER	11,5614%	-0,1394	-0,0064%	0,7319%	0,18%	352.386.285,47	251
10	CLIENTE V - BRADESCO	11,3432%	-0,0501	-0,0071%	2,2582%	0,34%	258.411.042,55	251
11	CLIENTE Y - BNP	11,2043%	-0,0983	-0,0077%	1,2434%	0,16%	271.303.181,18	251
12	CLIENTE Y - WESTERN	11,0204%	-0,1349	-0,0084%	0,9845%	0,10%	271.379.937,94	251
13	CLIENTE D - WESTERN	9,6651%	-0,1095	-0,0132%	1,9141%	0,00%	248.199.430,13	251
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	9,1365%	-0,1395	-0,0151%	1,7219%	0,35%	109.772.819,50	251
15	CLIENTE V - WESTERN	7,6426%	-0,1340	-0,0206%	2,4368%	0,38%	91.291.423,43	251
	MÉDIA:	11,4328%	-0,0756	-0,0069%	1,3143%		445.851.817,92	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/04/2023
 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

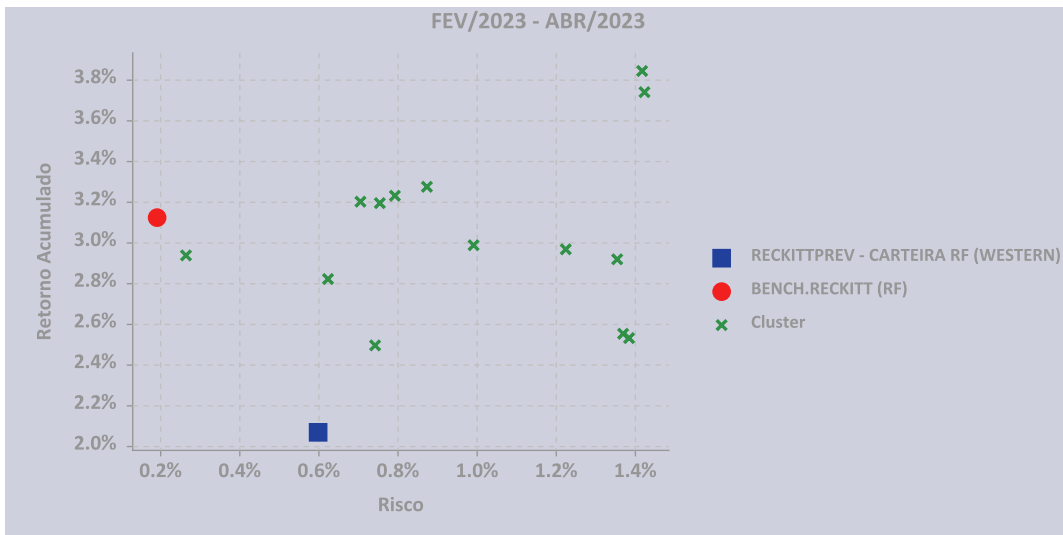
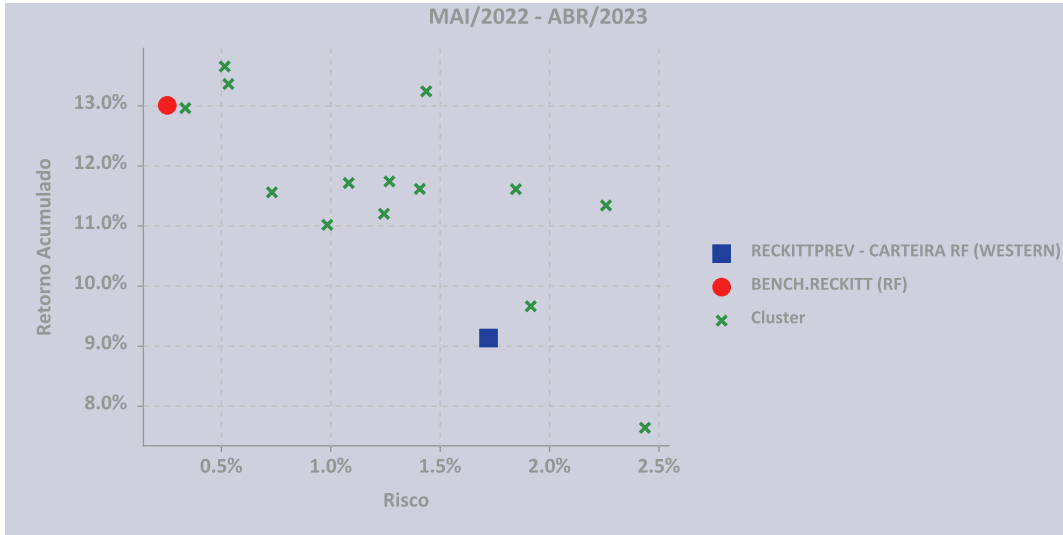
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE V - BRADESCO	3,8451%	0,1481	0,0132%	1,4171%	0,34%	258.411.042,55	59
2	CLIENTE V - ITAÚ	3,7412%	0,1285	0,0115%	1,4232%	0,38%	313.046.717,74	59
3	CLIENTE Y - BNP	3,2762%	0,0705	0,0039%	0,8738%	0,16%	271.303.181,18	59
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	3,2323%	0,0632	0,0032%	0,7924%	0,10%	735.219.366,70	59
5	CLIENTE X - BRADESCO	3,2035%	0,0603	0,0027%	0,7055%	0,13%	967.905.778,44	59
6	CLIENTE O - BRADESCO	3,1961%	0,0539	0,0026%	0,7543%	0,18%	345.652.177,73	59
7	CLIENTE X - ITAU	2,9897%	-0,0132	-0,0008%	0,9914%	0,13%	1.074.263.553,11	59
8	CLIENTE D - WESTERN	2,9698%	-0,0148	-0,0011%	1,2248%	0,00%	248.199.430,13	59
9	CLIENTE V - SANTANDER	2,9392%	-0,1007	-0,0017%	0,2642%	0,20%	619.170.359,40	59
10	CLIENTE M - BAHIA	2,9209%	-0,0228	-0,0019%	1,3545%	0,77%	94.430.830,41	59
11	CLIENTE Y - WESTERN	2,8231%	-0,0913	-0,0036%	0,6231%	0,10%	271.379.937,94	59
12	CLIENTE V - WESTERN	2,5542%	-0,0927	-0,0080%	1,3693%	0,38%	91.291.423,43	59
13	CLIENTE X - WESTERN	2,5336%	-0,0956	-0,0083%	1,3842%	0,10%	935.344.365,12	59
14	CLIENTE O - SANTANDER	2,4978%	-0,1915	-0,0090%	0,7422%	0,18%	352.386.285,47	59
15	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	2,0706%	-0,4252	-0,0160%	0,5988%	0,35%	109.772.819,50	59
	MÉDIA:	2,9862%	-0,0349	-0,0009%	0,9679%		445.851.817,92	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/04/2023 A 28/04/2023
 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 V - BRADESCO	1,2069%	0,1858	0,0159%	1,3600%	0,34%	258.411.042,55	18
2	CLIENTE V - ITAÚ	1,1839%	0,1647	0,0147%	1,4131%	0,38%	313.046.717,74	18
3	CLIENTE D - WESTERN	1,0856%	0,1352	0,0092%	1,0850%	0,00%	248.199.430,13	18
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	0,9177%	-0,0004	-0,0000%	0,6265%	0,10%	735.219.366,70	18
5	CLIENTE Y - BNP	0,9085%	-0,0111	-0,0005%	0,7413%	0,16%	271.303.181,18	18
6	CLIENTE V - SANTANDER	0,8805%	-0,1601	-0,0021%	0,2054%	0,20%	619.170.359,40	18
7	CLIENTE O - BRADESCO	0,8786%	-0,0521	-0,0022%	0,6617%	0,18%	345.652.177,73	18
8	CLIENTE V - WESTERN	0,8762%	-0,0307	-0,0023%	1,1794%	0,38%	91.291.423,43	18
9	CLIENTE X - BRADESCO	0,8734%	-0,0634	-0,0025%	0,6145%	0,13%	967.905.778,44	18
10	CLIENTE X - WESTERN	0,8624%	-0,0219	-0,0030%	2,1658%	0,10%	935.344.365,12	18
11	CLIENTE M - BAHIA	0,8383%	-0,0893	-0,0044%	0,7802%	0,77%	94.430.830,41	18
12	CLIENTE Y - WESTERN	0,8291%	-0,2185	-0,0049%	0,3565%	0,10%	271.379.937,94	18
13	CLIENTE X - ITAU	0,8232%	-0,0691	-0,0052%	1,1968%	0,13%	1.074.263.553,11	18
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,7511%	-0,3736	-0,0092%	0,3910%	0,35%	109.772.819,50	18
15	CLIENTE O - SANTANDER	0,7387%	-0,3616	-0,0099%	0,4341%	0,18%	352.386.285,47	18
	MÉDIA:	0,9103%	-0,0644	-0,0004%	0,8807%		445.851.817,92	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Abril/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: 1,84329
 PATRIMÔNIO: 8.318.777,01

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	89,72%
	IVBX-2	6,20%	SMLL	1,49%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,54%
	IMA-B	2,05%		

ESTILO: 98,91%

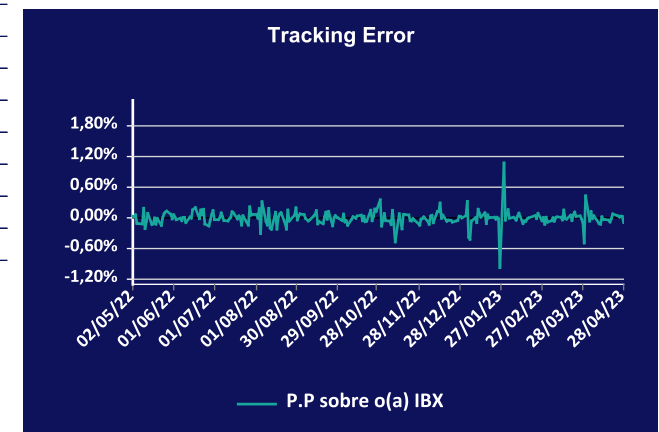
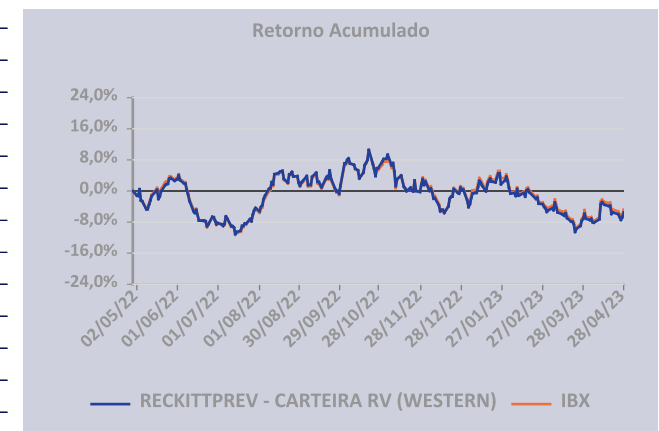
SELEÇÃO: 1,09%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0638%	31° de 33
RETORNO ACUMULADO	-5,5297%	30° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-4,7985%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7311%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0040%	12° de 33
BETA	0,9789	25° de 33
MARKET TIMING	-0,4735	30° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9884	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	29,6094%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	87,8046%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,3610	31° de 33
JENSEN	-1,1225%	31° de 33
MODIGLIANI	-1,0338%	31° de 33
SHARPE	-0,0477	31° de 33
SORTINO	-0,0650	31° de 33
TREYNOR	-0,0006	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	21,1996	--
DOWNSIDE RISK	0,9808%	14° de 33
RISCO ATIVO	0,1474%	9° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,3399%	9° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1444%	9° de 33
RISCO TOTAL	1,3356%	23° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	21,2024%	23° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	7
MESES NEGATIVOS	5
MESES ACIMA DO IBX	6
MESES ABAIXO DO IBX	6
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	1,71%	-5,90%	-5,53%	-17,43%	21,16%	5,54% (03/10/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	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: 1,84329
 PATRIMÔNIO: 8.318.777,01

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	IBX	IBX	86,02%
	1,86%			
	6,03%	SMLL		0,00%
	3,23%	IRF-M		0,00%
	2,86%			

ESTILO: 99,45%

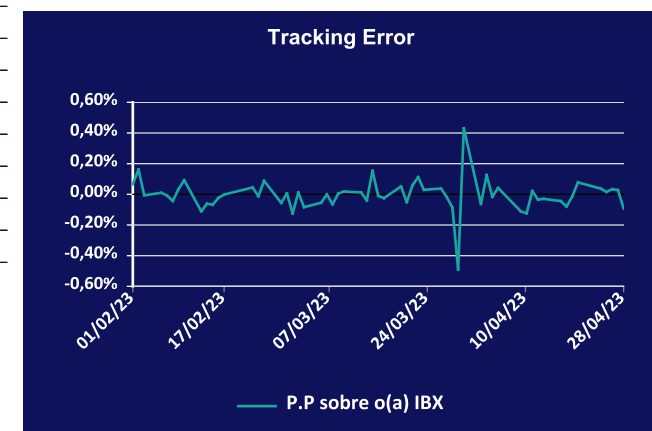
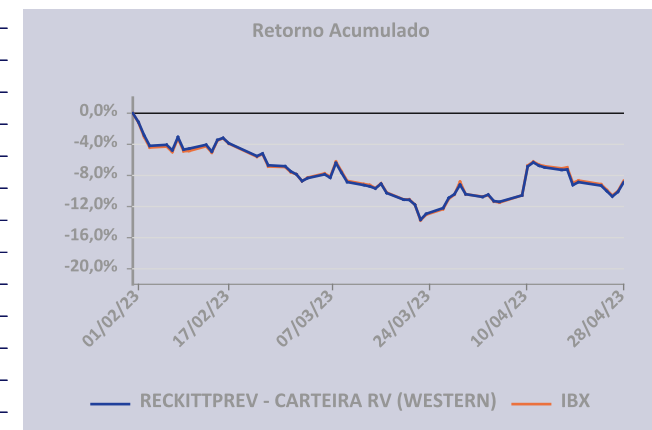
SELEÇÃO: 0,55%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,2018%	19° de 33
RETORNO ACUMULADO	-8,8777%	19° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-8,6895%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1881%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0192%	30° de 33
BETA	0,9509	30° de 33
MARKET TIMING	0,3768	4° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9936	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	81,0865%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	55,1832%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,6053	20° de 33
JENSEN	-0,7358%	24° de 33
MODIGLIANI	-0,7319%	24° de 33
SHARPE	-0,1762	24° de 33
SORTINO	-0,2383	24° de 33
TREYNOR	-0,0021	24° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	12,1250	--
DOWNSIDE RISK	0,8466%	30° de 33
RISCO ATIVO	0,1072%	9° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,7021%	9° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0914%	10° de 33
RISCO TOTAL	1,1451%	29° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	18,1788%	29° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,7072%(04/2023)
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	1,71%	-5,90%	-5,53%	-17,43%	21,16%	4,16% (11/04/2023)	-2,19% (23/03/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-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: 1,84329
 PATRIMÔNIO: 8.318.777,01

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	89,25%
	IVBX-2	6,60%	SMLL	1,14%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	3,01%		

ESTILO: 99,46%

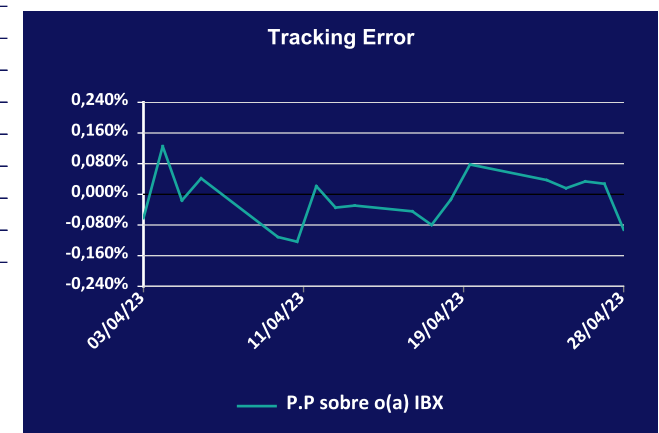
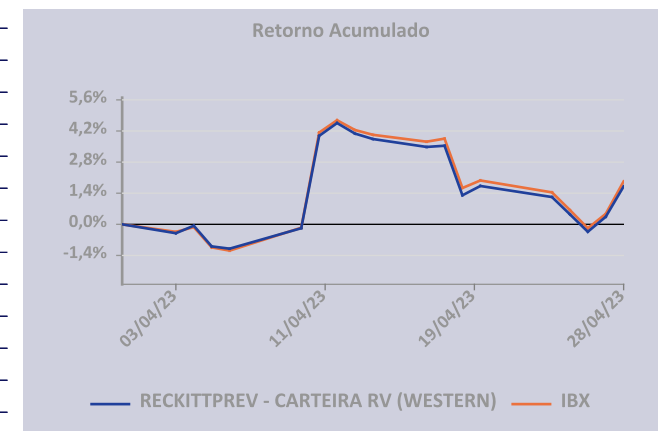
SELEÇÃO: 0,54%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0510%	26° de 33
RETORNO ACUMULADO	1,7071%	26° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,9316%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2244%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0042%	21° de 33
BETA	0,9882	22° de 33
MARKET TIMING	-0,4619	23° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9979	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	19,9049%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	63,7968%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,9981	22° de 33
JENSEN	-0,2022%	25° de 33
MODIGLIANI	-0,2076%	26° de 33
SHARPE	0,0395	26° de 33
SORTINO	0,0757	27° de 33
TREYNOR	0,0005	26° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,1641	--
DOWNSIDE RISK	0,6743%	11° de 33
RISCO ATIVO	0,0666%	12° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,0579%	12° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0600%	11° de 33
RISCO TOTAL	1,2926%	25° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	20,5207%	25° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,7072%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,7072%(04/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,71%	-5,90%	-5,53%	-17,43%	21,16%	4,16% (11/04/2023)	-2,15% (19/04/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,12% (19/04/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,14% (19/04/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-1,73% (19/04/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-2,73% (19/04/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-1,47% (19/04/2023)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2022 A 28/04/2023
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	4,2008%	1,0219	-1,7074%	23,2518%	1,70%	96.856.972,10	251
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	3,7020%	0,9330	-0,3473%	20,4269%	0,75%	81.479.959,53	251
3	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	3,6787%	0,8847	0,2669%	19,4818%	0,41%	412.660.017,77	251
4	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	3,3305%	0,9491	-0,9642%	20,8109%	2,00%	352.387.050,50	251
5	OCEANA VALOR FC FI ACOES	2,9803%	0,9431	-1,2662%	20,7593%	2,00%	284.302.284,78	251
6	IAJA SAM ACOES FI	1,9616%	1,0105	-3,0967%	21,8868%	0,22%	127.947.099,94	251
7	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,9048%	1,0250	-3,3270%	22,1153%	0,70%	29.046.231,32	251
8	IAJA ACOES FC FIA	1,8749%	0,9939	-2,9288%	21,5486%	0,08%	203.060.882,59	251
9	MULTIPREV FIA	1,4316%	0,9834	-3,1130%	21,2152%	0,00%	654.440.196,65	251
10	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	1,1135%	1,0062	-3,7953%	21,6810%	0,00%	166.084.994,86	251
11	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	1,0847%	0,9892	-3,5438%	21,3274%	0,00%	348.036.268,33	251
12	BRAM FIA IBRX ATIVO	1,0056%	0,9892	-3,6208%	21,3259%	0,00%	356.709.389,94	251
13	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,9701%	0,9903	-3,6747%	21,3494%	0,00%	125.133.880,18	251
14	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,7365%	1,0006	-4,0723%	21,5544%	0,00%	1.060.901.325,74	251
15	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,6125%	0,9793	-3,8267%	21,1012%	0,00%	210.399.158,93	251
16	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,5635%	1,0001	-4,2381%	21,5455%	0,15%	171.960.731,20	251
17	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,4977%	0,9779	-3,9129%	21,0691%	0,30%	34.495.821,69	251
18	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3809%	1,0003	-4,4234%	21,5487%	0,30%	50.145.619,10	251
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,3647%	0,9784	-4,0560%	21,0849%	0,00%	67.673.574,40	251
20	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,3485%	0,9935	-4,3357%	21,4036%	0,15%	125.913.527,15	251
21	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,3165%	0,9709	-4,0120%	20,9749%	0,15%	64.360.254,10	251
22	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,3118%	0,9967	-4,4358%	21,4804%	0,56%	64.876.548,91	251
23	BRADESCO FIA SALUBRE	0,3118%	0,9817	-4,1747%	21,1656%	0,50%	124.755.021,38	251
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,2995%	0,9950	-4,4112%	21,4359%	0,19%	25.979.758,70	251
25	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,2984%	0,9887	-4,3133%	21,3166%	0,70%	11.727.759,77	251
26	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,2194%	0,9977	-4,5371%	21,4914%	0,10%	505.294.418,48	251
27	COMSHELL CONCHA FIA	0,1410%	0,9850	-4,3890%	21,2211%	0,17%	62.737.123,79	251
28	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,0785%	0,9895	-4,5438%	21,3320%	0,90%	187.756.392,21	251
29	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,1005%	0,9913	-5,7414%	22,5344%	1,85%	151.661.324,90	251
30	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,4871%	0,9641	-4,6235%	20,7776%	0,75%	35.218.776,39	251
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-1,0338%	0,9790	-5,5297%	21,2024%	0,35%	8.318.777,01	251
32	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-1,5575%	0,9967	-6,2936%	21,4736%	0,09%	364.730.916,74	251
33	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-1,6584%	0,9956	-6,3726%	21,4502%	0,01%	365.011.008,56	251
	MÉDIA:	0,9056%	0,9843	-3,7382%	21,3437%		210.062.517,20	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/04/2023
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	3,1213%	0,9696	-5,6415%	19,1700%	1,85%	151.661.324,90	59
2	RPS FIC FI ACOES SELECTION	1,9412%	1,1793	-9,6590%	24,6600%	1,70%	96.856.972,10	59
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	1,4766%	1,0056	-7,4523%	19,4520%	2,00%	284.302.284,78	59
4	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	1,4748%	1,0075	-7,4660%	19,4740%	2,00%	352.387.050,50	59
5	MULTIPREV FIA	0,6012%	1,0050	-8,1448%	19,1047%	0,00%	654.440.196,65	59
6	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,2454%	1,0058	-8,5214%	19,1362%	0,00%	166.084.994,86	59
7	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,1522%	1,0004	-8,5419%	19,0159%	0,00%	1.060.901.325,74	59
8	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,1113%	1,0006	-8,5848%	19,0190%	0,15%	171.960.731,20	59
9	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0904%	0,9959	-8,5526%	18,9323%	0,15%	125.913.527,15	59
10	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0779%	1,0005	-8,6172%	19,0173%	0,30%	50.145.619,10	59
11	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0418%	0,9973	-8,6163%	18,9571%	0,19%	25.979.758,70	59
12	COMSHELL CONCHA FIA	0,0385%	0,9884	-8,5171%	18,7904%	0,17%	62.737.123,79	59
13	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0120%	0,9978	-8,6516%	18,9662%	0,10%	505.294.418,48	59
14	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0008%	0,9965	-8,6361%	18,9230%	0,56%	64.876.548,91	59
15	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1822%	0,9538	-8,3348%	18,1514%	0,30%	34.495.821,69	59
16	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1864%	1,0164	-9,1229%	19,4023%	0,70%	29.046.231,32	59
17	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,2260%	0,9735	-8,6119%	18,5256%	0,00%	210.399.158,93	59
18	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,3041%	0,9727	-8,6783%	18,5103%	0,00%	67.673.574,40	59
19	IAJA ACOES FC FIA	-0,4529%	0,9735	-8,8738%	18,5891%	0,08%	203.060.882,59	59
20	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,5884%	0,9498	-8,6642%	18,0613%	0,75%	35.218.776,39	59
21	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,6549%	0,9913	-9,2398%	18,8476%	0,00%	348.036.268,33	59
22	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-0,6679%	0,9920	-9,2452%	18,8362%	0,00%	125.133.880,18	59
23	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,6738%	0,9893	-9,2293%	18,8028%	0,00%	356.709.389,94	59
24	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,7320%	0,9509	-8,8777%	18,1789%	0,35%	8.318.777,01	59
25	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,7834%	0,9893	-9,3354%	18,7994%	0,70%	11.727.759,77	59
26	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,8097%	0,9862	-9,3155%	18,7297%	0,50%	124.755.021,38	59
27	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,8382%	0,9535	-8,9886%	18,1929%	0,15%	64.360.254,10	59
28	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,8805%	0,9896	-9,4377%	18,8089%	0,90%	187.756.392,21	59
29	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,9824%	0,9924	-9,5784%	18,8685%	0,09%	364.730.916,74	59
30	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-1,0009%	0,9917	-9,5877%	18,8548%	0,01%	365.011.008,56	59
31	IAJA SAM ACOES FI	-1,1240%	0,9899	-9,7439%	18,9054%	0,22%	127.947.099,94	59
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,6979%	0,9140	-9,5360%	17,8031%	0,41%	412.660.017,77	59
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-1,8742%	0,9222	-9,7762%	17,9080%	0,75%	81.479.959,53	59
	MÉDIA:	-0,1598%	0,9892	-8,7812%	18,9513%		210.062.517,20	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/04/2023 A 28/04/2023
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	1,0778%	1,1433	3,2402%	23,2702%	1,85%	151.661.324,90	18
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	0,8642%	1,0015	2,7541%	20,4914%	2,00%	284.302.284,78	18
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,8360%	0,9987	2,7190%	20,4074%	2,00%	352.387.050,50	18
4	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,4282%	0,9336	2,2452%	19,2918%	0,41%	412.660.017,77	18
5	MULTIPREV FIA	0,3881%	0,9913	2,2950%	20,5884%	0,00%	654.440.196,65	18
6	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,1979%	0,9192	2,0061%	18,8229%	0,75%	81.479.959,53	18
7	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,1204%	1,0389	2,0906%	21,6704%	0,70%	29.046.231,32	18
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0475%	0,9954	1,9755%	20,8872%	0,15%	125.913.527,15	18
9	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,0464%	1,0009	1,9786%	20,9690%	0,00%	1.060.901.325,74	18
10	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0320%	1,0008	1,9641%	20,9678%	0,15%	171.960.731,20	18
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0219%	1,0008	1,9540%	20,9685%	0,30%	50.145.619,10	18
12	COMSHELL CONCHA FIA	0,0185%	0,9904	1,9397%	20,7466%	0,17%	62.737.123,79	18
13	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,0173%	1,0120	1,9604%	21,1919%	0,00%	166.084.994,86	18
14	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0115%	0,9982	1,9407%	20,9081%	0,19%	25.979.758,70	18
15	SANTANDER FI IBRX ACOES	-0,0125%	0,9972	1,9168%	20,9088%	0,10%	505.294.418,48	18
16	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0318%	1,0002	1,8941%	20,8359%	0,56%	64.876.548,91	18
17	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-0,0453%	1,2029	2,1747%	27,2005%	1,70%	96.856.972,10	18
18	IAJA ACOES FC FIA	-0,0582%	0,9783	1,8355%	20,1269%	0,08%	203.060.882,59	18
19	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,0796%	0,9867	1,8350%	20,5759%	0,00%	210.399.158,93	18
20	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,0814%	0,9366	1,8070%	19,9882%	0,15%	64.360.254,10	18
21	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0888%	0,9532	1,8027%	20,0475%	0,30%	34.495.821,69	18
22	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,1262%	0,9867	1,7878%	20,5419%	0,00%	67.673.574,40	18
23	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,1986%	0,9586	1,6938%	19,9493%	0,75%	35.218.776,39	18
24	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-0,2009%	0,9864	1,7183%	20,6364%	0,00%	125.133.880,18	18
25	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,2046%	0,9911	1,7203%	20,7843%	0,00%	348.036.268,33	18
26	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,2076%	0,9882	1,7072%	20,5207%	0,35%	8.318.777,01	18
27	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,2110%	0,9881	1,7108%	20,7024%	0,00%	356.709.389,94	18
28	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,2279%	0,9828	1,6882%	20,5454%	0,50%	124.755.021,38	18
29	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,2764%	0,9887	1,6454%	20,6784%	0,70%	11.727.759,77	18
30	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,2844%	0,9885	1,6385%	20,7083%	0,90%	187.756.392,21	18
31	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,4683%	1,0077	1,4596%	20,8128%	0,09%	364.730.916,74	18
32	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,4737%	1,0070	1,4538%	20,7975%	0,01%	365.011.008,56	18
33	IAJA SAM ACOES FI	-0,4948%	1,0007	1,4330%	20,8051%	0,22%	127.947.099,94	18
	MÉDIA:	0,0102%	0,9986	1,9390%	20,8590%		210.062.517,20	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2022 A 28/04/2023
 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	0,2669%	2,9566%	0,8847	19,4818%	0,41%	412.660.017,77	251
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,3473%	3,2230%	0,9330	20,4269%	0,75%	81.479.959,53	251
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,9642%	2,9076%	0,9491	20,8109%	2,00%	352.387.050,50	251
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-1,2662%	2,5008%	0,9431	20,7593%	2,00%	284.302.284,78	251
5	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-1,7074%	3,4846%	1,0219	23,2518%	1,70%	96.856.972,10	251
6	IAJA ACOES FC FIA	-2,9288%	1,7491%	0,9939	21,5486%	0,08%	203.060.882,59	251
7	IAJA SAM ACOES FI	-3,0967%	1,8874%	1,0105	21,8868%	0,22%	127.947.099,94	251
8	MULTIPREV FIA	-3,1130%	1,3802%	0,9834	21,2152%	0,00%	654.440.196,65	251
9	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,3270%	1,9285%	1,0250	22,1153%	0,70%	29.046.231,32	251
10	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-3,5438%	1,0601%	0,9892	21,3274%	0,00%	348.036.268,33	251
11	BRAM FIA IBRX ATIVO	-3,6208%	0,9820%	0,9892	21,3259%	0,00%	356.709.389,94	251
12	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-3,6747%	0,9479%	0,9903	21,3494%	0,00%	125.133.880,18	251
13	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-3,7953%	1,1169%	1,0062	21,6810%	0,00%	166.084.994,86	251
14	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-3,8267%	0,5937%	0,9793	21,1012%	0,00%	210.399.158,93	251
15	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,9129%	0,4847%	0,9779	21,0691%	0,30%	34.495.821,69	251
16	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-4,0120%	0,2598%	0,9709	20,9749%	0,15%	64.360.254,10	251
17	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-4,0560%	0,3475%	0,9784	21,0849%	0,00%	67.673.574,40	251
18	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-4,0723%	0,7368%	1,0006	21,5544%	0,00%	1.060.901.325,74	251
19	BRADESCO FIA SALUBRE	-4,1747%	0,2928%	0,9817	21,1656%	0,50%	124.755.021,38	251
20	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-4,2381%	0,5633%	1,0001	21,5455%	0,15%	171.960.731,20	251
21	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-4,3133%	0,2811%	0,9887	21,3166%	0,70%	11.727.759,77	251
22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-4,3357%	0,3456%	0,9935	21,4036%	0,15%	125.913.527,15	251
23	COMSHELL CONCHA FIA	-4,3890%	0,1375%	0,9850	21,2211%	0,17%	62.737.123,79	251
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-4,4112%	0,2977%	0,9950	21,4359%	0,19%	25.979.758,70	251
25	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-4,4234%	0,3809%	1,0003	21,5487%	0,30%	50.145.619,10	251
26	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-4,4358%	0,3015%	0,9967	21,4804%	0,56%	64.876.548,91	251
27	SANTANDER FI IBRX ACOES	-4,5371%	0,2187%	0,9977	21,4914%	0,10%	505.294.418,48	251
28	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-4,5438%	0,0641%	0,9895	21,3320%	0,90%	187.756.392,21	251
29	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-4,6235%	-0,4806%	0,9641	20,7776%	0,75%	35.218.776,39	251
30	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-5,5297%	-1,1225%	0,9790	21,2024%	0,35%	8.318.777,01	251
31	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,7414%	-1,1192%	0,9913	22,5344%	1,85%	151.661.324,90	251
32	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-6,2936%	-1,5585%	0,9967	21,4736%	0,09%	364.730.916,74	251
33	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-6,3726%	-1,6575%	0,9956	21,4502%	0,01%	365.011.008,56	251
	MÉDIA:	-3,7382%	0,7725%	0,9843	21,3437%		210.062.517,20	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/04/2023
 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

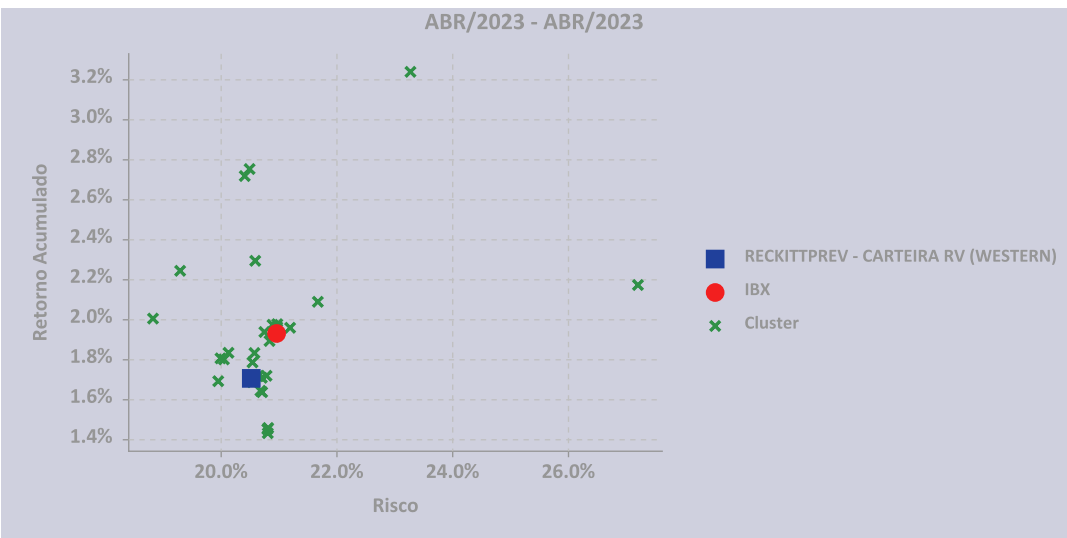
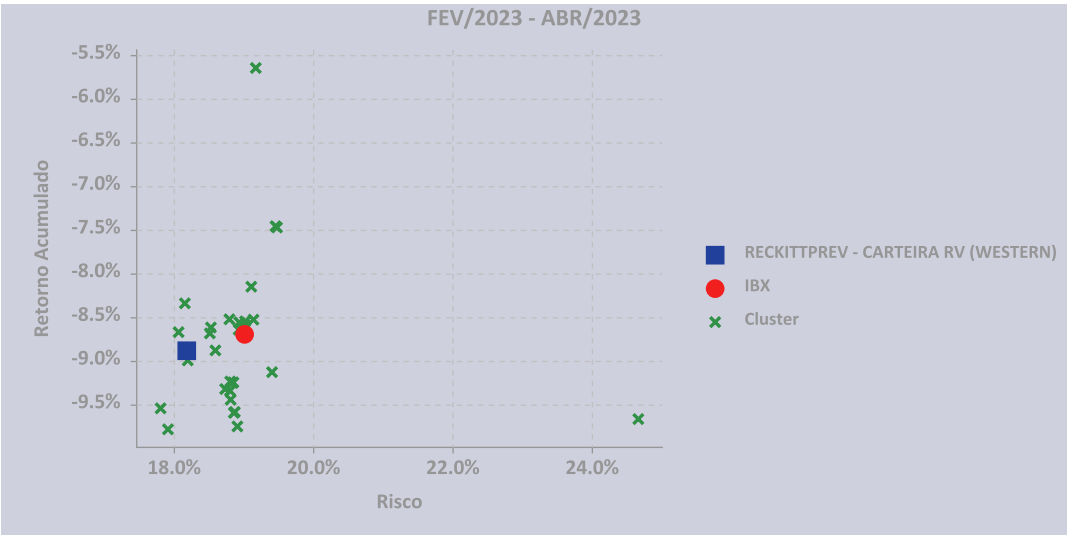
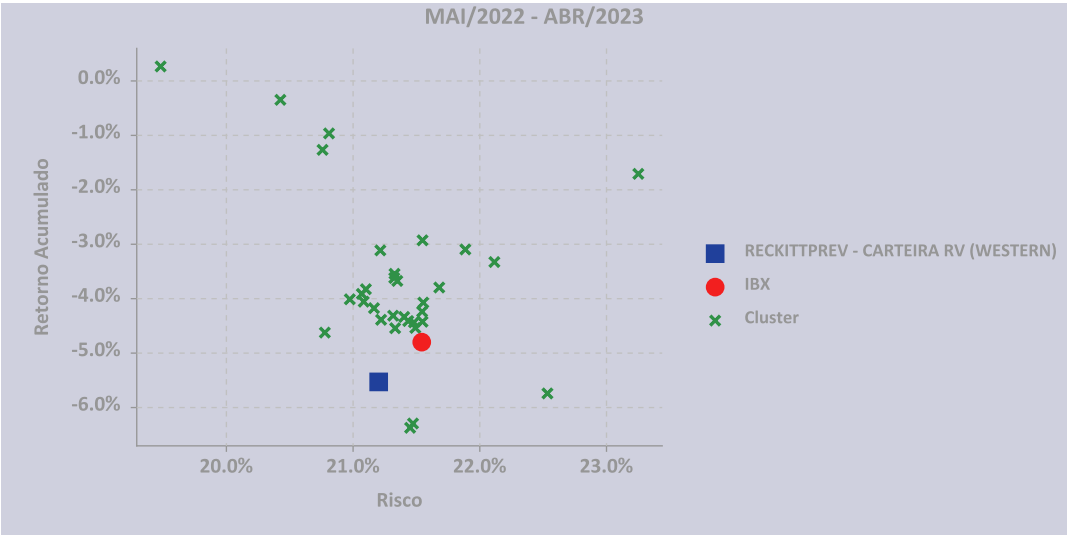
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,6415%	2,7084%	0,9696	19,1700%	1,85%	151.661.324,90	59
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-7,4523%	1,2636%	1,0056	19,4520%	2,00%	284.302.284,78	59
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-7,4660%	1,2650%	1,0075	19,4740%	2,00%	352.387.050,50	59
4	MULTIPREV FIA	-8,1448%	0,5700%	1,0050	19,1047%	0,00%	654.440.196,65	59
5	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-8,3348%	-0,1748%	0,9538	18,1514%	0,30%	34.495.821,69	59
6	COMSHELL CONCHA FIA	-8,5171%	0,0379%	0,9884	18,7904%	0,17%	62.737.123,79	59
7	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-8,5214%	0,2456%	1,0058	19,1362%	0,00%	166.084.994,86	59
8	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-8,5419%	0,1523%	1,0004	19,0159%	0,00%	1.060.901.325,74	59
9	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-8,5526%	0,0896%	0,9959	18,9323%	0,15%	125.913.527,15	59
10	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-8,5848%	0,1113%	1,0006	19,0190%	0,15%	171.960.731,20	59
11	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-8,6119%	-0,2232%	0,9735	18,5256%	0,00%	210.399.158,93	59
12	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-8,6163%	0,0415%	0,9973	18,9571%	0,19%	25.979.758,70	59
13	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-8,6172%	0,0779%	1,0005	19,0173%	0,30%	50.145.619,10	59
14	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-8,6361%	-0,0021%	0,9965	18,9230%	0,56%	64.876.548,91	59
15	SANTANDER FI IBRX ACOES	-8,6516%	0,0119%	0,9978	18,9662%	0,10%	505.294.418,48	59
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-8,6642%	-0,5642%	0,9498	18,0613%	0,75%	35.218.776,39	59
17	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-8,6783%	-0,3013%	0,9727	18,5103%	0,00%	67.673.574,40	59
18	IAJA ACOES FC FIA	-8,8738%	-0,5294%	0,9735	18,5891%	0,08%	203.060.882,59	59
19	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-8,8777%	-0,7359%	0,9509	18,1789%	0,35%	8.318.777,01	59
20	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-8,9886%	-0,8258%	0,9535	18,1929%	0,15%	64.360.254,10	59
21	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-9,1229%	-0,2036%	1,0164	19,4023%	0,70%	29.046.231,32	59
22	BRAM FIA IBRX ATIVO	-9,2293%	-0,6732%	0,9893	18,8028%	0,00%	356.709.389,94	59
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-9,2398%	-0,6560%	0,9913	18,8476%	0,00%	348.036.268,33	59
24	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-9,2452%	-0,6692%	0,9920	18,8362%	0,00%	125.133.880,18	59
25	BRADESCO FIA SALUBRE	-9,3155%	-0,8045%	0,9862	18,7297%	0,50%	124.755.021,38	59
26	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-9,3354%	-0,7812%	0,9893	18,7994%	0,70%	11.727.759,77	59
27	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-9,4377%	-0,8779%	0,9896	18,8089%	0,90%	187.756.392,21	59
28	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-9,5360%	-1,8165%	0,9140	17,8031%	0,41%	412.660.017,77	59
29	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-9,5784%	-0,9848%	0,9924	18,8685%	0,09%	364.730.916,74	59
30	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-9,5877%	-1,0025%	0,9917	18,8548%	0,01%	365.011.008,56	59
31	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-9,6590%	1,3393%	1,1793	24,6600%	1,70%	96.856.972,10	59
32	IAJA SAM ACOES FI	-9,7439%	-1,1740%	0,9899	18,9054%	0,22%	127.947.099,94	59
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-9,7762%	-2,0151%	0,9222	17,9080%	0,75%	81.479.959,53	59
	MÉDIA:	-8,7812%	-0,2152%	0,9892	18,9513%		210.062.517,20	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/04/2023 A 28/04/2023
 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	3,2402%	1,2324%	1,1433	23,2702%	1,85%	151.661.324,90	18
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	2,7541%	0,8531%	1,0015	20,4914%	2,00%	284.302.284,78	18
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	2,7190%	0,8221%	0,9987	20,4074%	2,00%	352.387.050,50	18
4	MULTIPREV FIA	2,2950%	0,3833%	0,9913	20,5884%	0,00%	654.440.196,65	18
5	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	2,2452%	0,4048%	0,9336	19,2918%	0,41%	412.660.017,77	18
6	RPS FIC FI ACOES SELECTION	2,1747%	0,0365%	1,2029	27,2005%	1,70%	96.856.972,10	18
7	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	2,0906%	0,1251%	1,0389	21,6704%	0,70%	29.046.231,32	18
8	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	2,0061%	0,1906%	0,9192	18,8229%	0,75%	81.479.959,53	18
9	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	1,9786%	0,0465%	1,0009	20,9690%	0,00%	1.060.901.325,74	18
10	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	1,9755%	0,0474%	0,9954	20,8872%	0,15%	125.913.527,15	18
11	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	1,9641%	0,0320%	1,0008	20,9678%	0,15%	171.960.731,20	18
12	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	1,9604%	0,0176%	1,0120	21,1919%	0,00%	166.084.994,86	18
13	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	1,9540%	0,0219%	1,0008	20,9685%	0,30%	50.145.619,10	18
14	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	1,9407%	0,0115%	0,9982	20,9081%	0,19%	25.979.758,70	18
15	COMSHELL CONCHA FIA	1,9397%	0,0183%	0,9904	20,7466%	0,17%	62.737.123,79	18
16	SANTANDER FI IBRX ACOES	1,9168%	-0,0124%	0,9972	20,9088%	0,10%	505.294.418,48	18
17	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	1,8941%	-0,0315%	1,0002	20,8359%	0,56%	64.876.548,91	18
18	IAJA ACOES FC FIA	1,8355%	-0,0509%	0,9783	20,1269%	0,08%	203.060.882,59	18
19	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	1,8350%	-0,0779%	0,9867	20,5759%	0,00%	210.399.158,93	18
20	CITIPREVI INST FI EM ACOES	1,8070%	-0,0766%	0,9366	19,9882%	0,15%	64.360.254,10	18
21	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,8027%	-0,0849%	0,9532	20,0475%	0,30%	34.495.821,69	18
22	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	1,7878%	-0,1233%	0,9867	20,5419%	0,00%	67.673.574,40	18
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	1,7203%	-0,2025%	0,9911	20,7843%	0,00%	348.036.268,33	18
24	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	1,7183%	-0,1974%	0,9864	20,6364%	0,00%	125.133.880,18	18
25	BRAM FIA IBRX ATIVO	1,7108%	-0,2081%	0,9881	20,7024%	0,00%	356.709.389,94	18
26	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	1,7072%	-0,2022%	0,9882	20,5207%	0,35%	8.318.777,01	18
27	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	1,6938%	-0,1887%	0,9586	19,9493%	0,75%	35.218.776,39	18
28	BRADESCO FIA SALUBRE	1,6882%	-0,2230%	0,9828	20,5454%	0,50%	124.755.021,38	18
29	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	1,6454%	-0,2723%	0,9887	20,6784%	0,70%	11.727.759,77	18
30	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1,6385%	-0,2806%	0,9885	20,7083%	0,90%	187.756.392,21	18
31	BB ECO GOLD FI EM ACOES	1,4596%	-0,4646%	1,0077	20,8128%	0,09%	364.730.916,74	18
32	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	1,4538%	-0,4696%	1,0070	20,7975%	0,01%	365.011.008,56	18
33	IAJA SAM ACOES FI	1,4330%	-0,4875%	1,0007	20,8051%	0,22%	127.947.099,94	18
	MÉDIA:	1,9390%	0,0179%	0,9986	20,8590%		210.062.517,20	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: -.-
MULTIMERCADOS*

Abril/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: 1,83017
 PATRIMÔNIO: 16.051.316,20

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	91,68%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,27%	SMLL	1,31%
IDIV	0,00%	IRF-M	4,99%
IMA B 5	1,56%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,18%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 33,33%

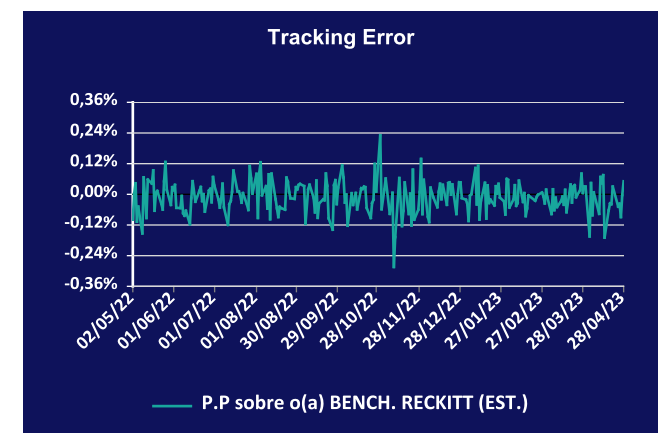
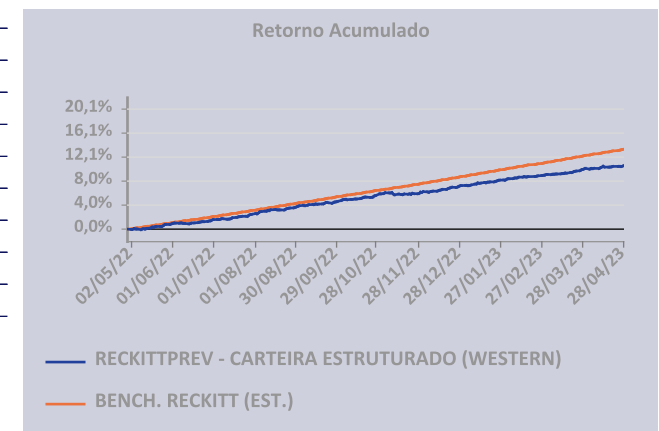
SELEÇÃO: 66,67%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0097%	--
RETORNO ACUMULADO	10,6416%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,3814%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,7398%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0171	--
SHARPE	-0,1540	--
SORTINO	-0,1903	--
STERLING RATIO	-0,1755	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,3816	--
DOWNSIDE RISK	0,0511%	--
RISCO ATIVO	0,0631%	--
RISCO TOTAL	0,0631%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,0029%	--

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	0,43%	3,13%	10,64%	14,80%	20,38%	0,28% (31/10/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,78% (10/11/2022)	-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: 1,83017
 PATRIMÔNIO: 16.051.316,20

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,20%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,80%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 4,31%

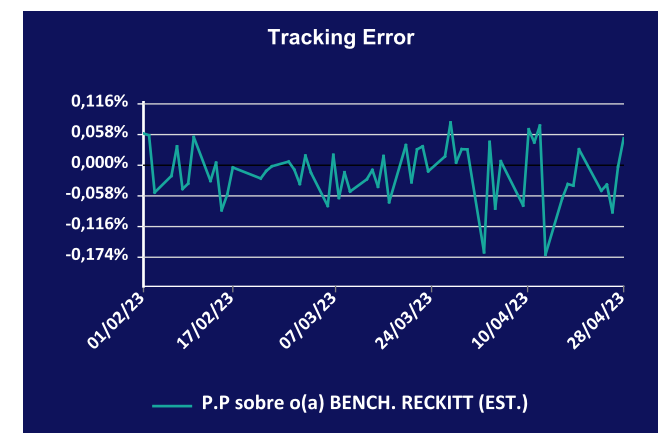
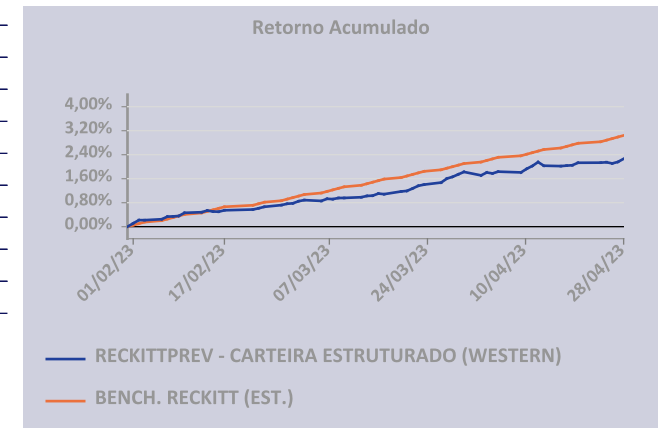
SELEÇÃO: 95,69%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0128%	--
RETORNO ACUMULADO	2,2623%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,0410%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7787%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0667	--
SHARPE	-0,2452	--
SORTINO	-0,2769	--
STERLING RATIO	-0,2909	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,6000	--
DOWNSIDE RISK	0,0463%	--
RISCO ATIVO	0,0523%	--
RISCO TOTAL	0,0523%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,8316%	--

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	0,4289%(04/2023)



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	0,43%	3,13%	10,64%	14,80%	20,38%	0,13% (28/03/2023)	-0,12% (14/04/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)

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: 1,83017
 PATRIMÔNIO: 16.051.316,20

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	95,65%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	3,11%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	1,24%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 41,16%

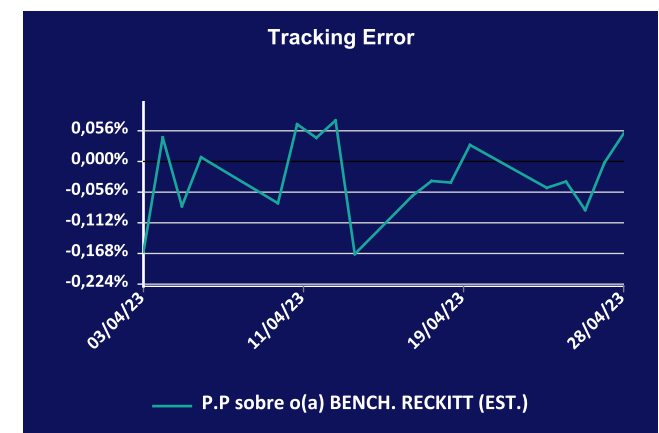
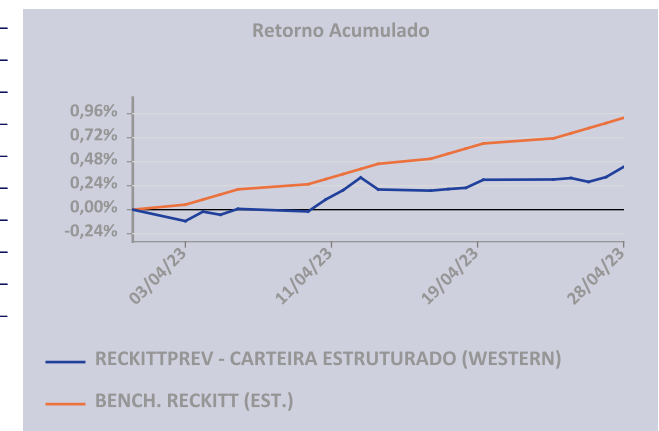
SELEÇÃO: 58,84%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0269%	--
RETORNO ACUMULADO	0,4289%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9181%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4891%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,1483	--
SHARPE	-0,3689	--
SORTINO	-0,3893	--
STERLING RATIO	-0,3978	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,1096	--
DOWNSIDE RISK	0,0692%	--
RISCO ATIVO	0,0731%	--
RISCO TOTAL	0,0731%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,1610%	--

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	0,4289%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,4289%(04/2023)



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	0,43%	3,13%	10,64%	14,80%	20,38%	0,13% (13/04/2023)	-0,12% (14/04/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,12% (19/04/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,14% (19/04/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-1,73% (19/04/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-2,73% (19/04/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-1,47% (19/04/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,21% (11/04/2023)	-0,10% (28/04/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,25%	4,92%	11,60%	17,13%	22,53%	0,27% (11/04/2023)	-0,16% (19/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)



*Agrupamento: -.-
INVEST. NO EXTERIOR*

Abril/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: 2,72530
 PATRIMÔNIO: 9.194.707,85

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	68,24%
DÓLAR PTAX	31,76%		

ESTILO: 61,99%

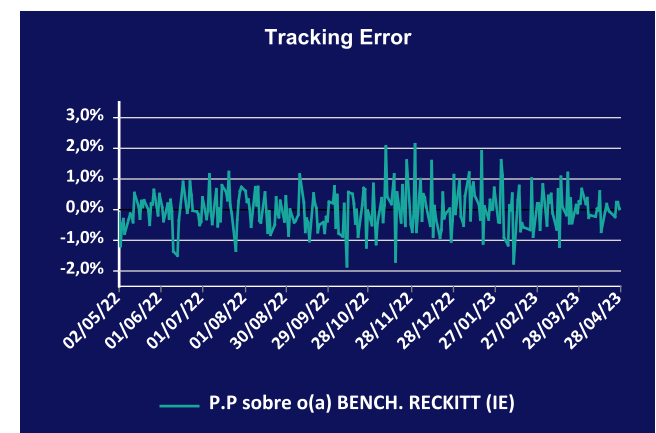
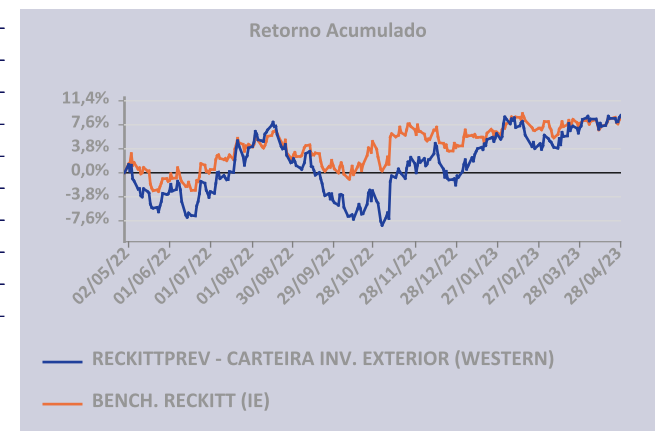
SELEÇÃO: 38,01%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0099%	--
RETORNO ACUMULADO	9,0947%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	8,6839%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,4108%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0006	--
SHARPE	-0,0096	--
SORTINO	-0,0142	--
STERLING RATIO	-0,0062	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,7361	--
DOWNSIDE RISK	0,7000%	--
RISCO ATIVO	0,6459%	--
RISCO TOTAL	1,0406%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	16,5197%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	6
MESES NEGATIVOS	6
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	6
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	6
MAIOR RETORNO MENSAL	8,1428%(07/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-6,8297%(09/2022)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,59%	9,88%	9,09%	-9,57%	14,06%	6,32% (10/11/2022)	-3,00% (03/11/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	0,41%	4,26%	8,68%	7,27%	30,49%	4,26% (10/11/2022)	-2,08% (18/05/2022)
MSCI EUROPE	3,62%	13,87%	9,08%	-0,58%	39,10%	4,58% (04/10/2022)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	1,59%	8,96%	1,44%	-3,50%	38,15%	5,05% (10/11/2022)	-3,66% (13/09/2022)
DÓLAR D2	-1,72%	-5,64%	0,98%	-7,82%	-8,46%	3,73% (10/11/2022)	-3,87% (03/10/2022)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,78% (10/11/2022)	-3,82% (03/10/2022)
EURO PTAX	-0,07%	-0,87%	6,47%	-15,09%	-6,95%	4,34% (10/11/2022)	-3,57% (03/10/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,00%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%	7,97% (10/11/2022)	-3,37% (03/11/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,15%	2,82%	2,44%	-11,04%	26,45%	8,97% (10/11/2022)	-3,74% (26/08/2022)
S&P 500	1,46%	8,59%	0,91%	-0,28%	43,16%	5,54% (10/11/2022)	-4,32% (13/09/2022)
S&P 500 BRL PTAX	-0,13%	4,08%	2,58%	-7,72%	31,92%	8,48% (10/11/2022)	-4,20% (18/05/2022)

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: 2,72530
 PATRIMÔNIO: 9.194.707,85

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	5,01%	MSCI WORLD	74,66%
DÓLAR PTAX	20,33%		

ESTILO: 57,56%

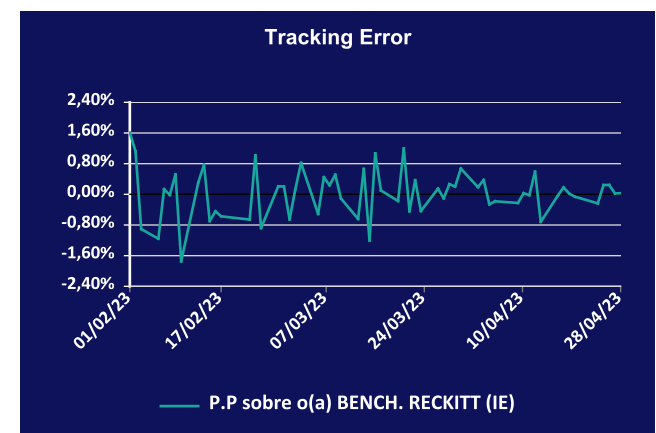
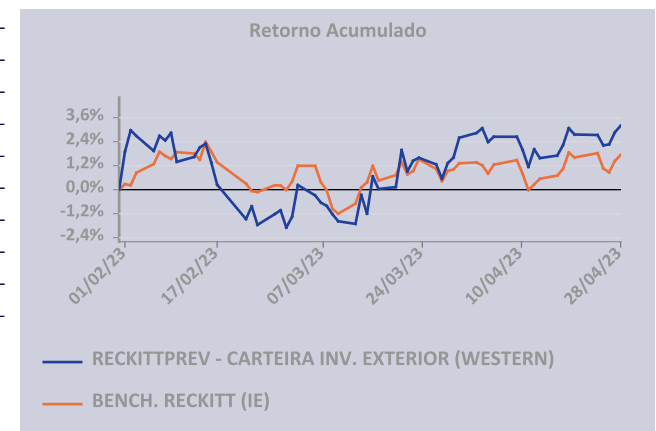
SELEÇÃO: 42,44%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0058%	--
RETORNO ACUMULADO	3,2003%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,7349%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,4653%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0010	--
SHARPE	0,0072	--
SORTINO	0,0108	--
STERLING RATIO	0,0050	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,3531	--
DOWNSIDE RISK	0,5347%	--
RISCO ATIVO	0,6251%	--
RISCO TOTAL	0,8054%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	12,7859%	--

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	3,6648%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,0319%(02/2023)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,59%	9,88%	9,09%	-9,57%	14,06%	1,89% (01/02/2023)	-1,71% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	0,41%	4,26%	8,68%	7,27%	30,49%	0,88% (15/02/2023)	-1,05% (22/02/2023)
MSCI EUROPE	3,62%	13,87%	9,08%	-0,58%	39,10%	2,02% (16/03/2023)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	1,59%	8,96%	1,44%	-3,50%	38,15%	1,50% (16/03/2023)	-1,54% (21/02/2023)
DÓLAR D2	-1,72%	-5,64%	0,98%	-7,82%	-8,46%	2,21% (03/02/2023)	-1,69% (27/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)
EURO PTAX	-0,07%	-0,87%	6,47%	-15,09%	-6,95%	2,04% (10/03/2023)	-1,46% (02/02/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,00%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%	1,53% (15/02/2023)	-2,30% (22/02/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,15%	2,82%	2,44%	-11,04%	26,45%	1,78% (23/03/2023)	-1,86% (22/02/2023)
S&P 500	1,46%	8,59%	0,91%	-0,28%	43,16%	1,96% (27/04/2023)	-2,16% (22/02/2023)
S&P 500 BRL PTAX	-0,13%	4,08%	2,58%	-7,72%	31,92%	1,71% (15/02/2023)	-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: 2,72530
 PATRIMÔNIO: 9.194.707,85

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	22,43%	MSCI WORLD	36,25%
DÓLAR PTAX	41,32%		

ESTILO: 66,01%

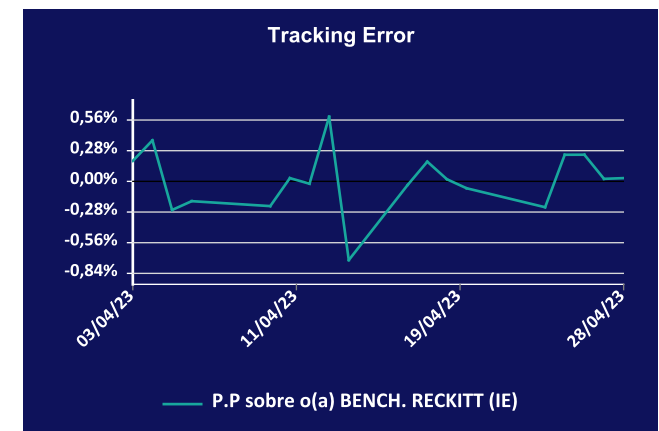
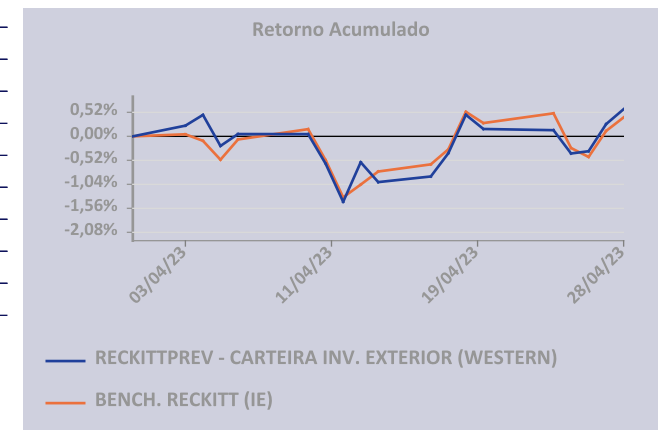
SELEÇÃO: 33,99%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0168%	--
RETORNO ACUMULADO	0,5898%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,4118%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,1780%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0090	--
SHARPE	-0,0331	--
SORTINO	-0,0457	--
STERLING RATIO	-0,0198	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,5331	--
DOWNSIDE RISK	0,3691%	--
RISCO ATIVO	0,2874%	--
RISCO TOTAL	0,5099%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	8,0957%	--

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	0,5898%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,5898%(04/2023)



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	0,59%	9,88%	9,09%	-9,57%	14,06%	0,87% (13/04/2023)	-0,83% (12/04/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	0,41%	4,26%	8,68%	7,27%	30,49%	0,82% (19/04/2023)	-0,81% (12/04/2023)
MSCI EUROPE	3,62%	13,87%	9,08%	-0,58%	39,10%	1,25% (11/04/2023)	-0,85% (17/04/2023)
MSCI WORLD	1,59%	8,96%	1,44%	-3,50%	38,15%	1,30% (27/04/2023)	-1,32% (25/04/2023)
DÓLAR D2	-1,72%	-5,64%	0,98%	-7,82%	-8,46%	1,74% (19/04/2023)	-1,69% (27/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)
EURO PTAX	-0,07%	-0,87%	6,47%	-15,09%	-6,95%	1,56% (19/04/2023)	-1,19% (27/04/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,00%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%	1,50% (19/04/2023)	-1,32% (12/04/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	-0,15%	2,82%	2,44%	-11,04%	26,45%	1,65% (19/04/2023)	-1,48% (12/04/2023)
S&P 500	1,46%	8,59%	0,91%	-0,28%	43,16%	1,96% (27/04/2023)	-1,58% (25/04/2023)
S&P 500 BRL PTAX	-0,13%	4,08%	2,58%	-7,72%	31,92%	1,58% (19/04/2023)	-1,67% (12/04/2023)

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)*

Abril/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: 2,45593
 PATRIMÔNIO: 143.337.620,57

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	90,20%	IBX	5,38%
	IVBX-2	0,73%	SMLL	2,64%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,02%
	IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,02%

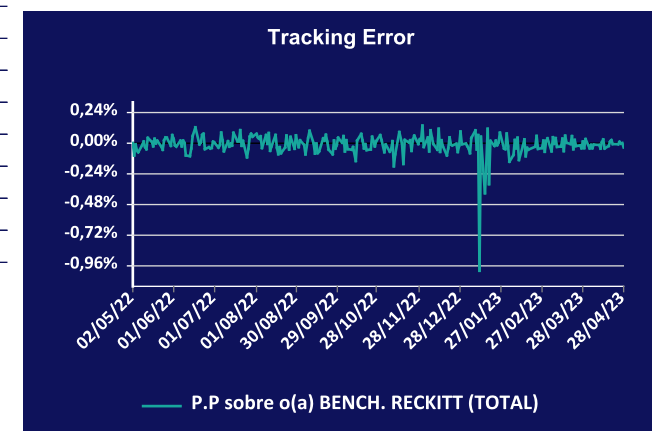
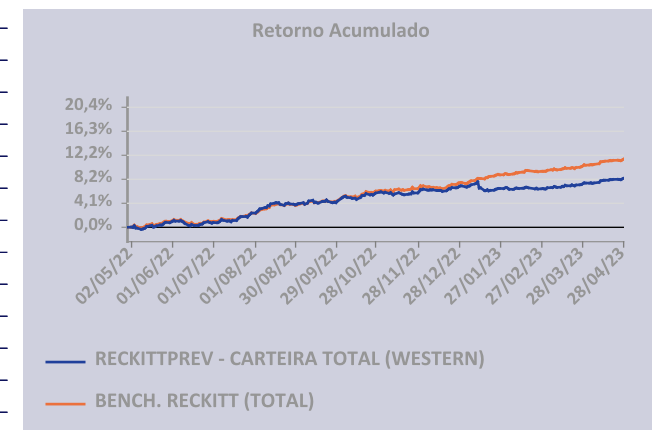
ESTILO: 60,22% | SELEÇÃO: 39,78%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0179%	--
RETORNO ACUMULADO	8,3472%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,6184%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,2712%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0088%	--
BETA	0,0867	--
MARKET TIMING	-0,2087	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5726	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	75,8981%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	66,6277%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,1336	--
JENSEN	-3,4607%	--
MODIGLIANI	-25,7908%	--
SHARPE	-0,1157	--
SORTINO	-0,1397	--
TREYNOR	-0,0020	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	65,5628	--
DOWNSIDE RISK	0,1286%	--
RISCO ATIVO	0,0879%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,3953%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1017%	--
RISCO TOTAL	0,1553%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,4663%	--

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	-0,3254%(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	0,76%	1,22%	8,35%	8,87%	22,56%	0,48% (03/10/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	3,72%	11,62%	16,88%	30,80%	0,48% (03/10/2022)	-0,33% (05/05/2022)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (02/05/2022)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,78% (10/11/2022)	-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: 2,45593
 PATRIMÔNIO: 143.337.620,57

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	92,91%	IBX	5,06%
IVBX-2	0,41%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	1,62%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

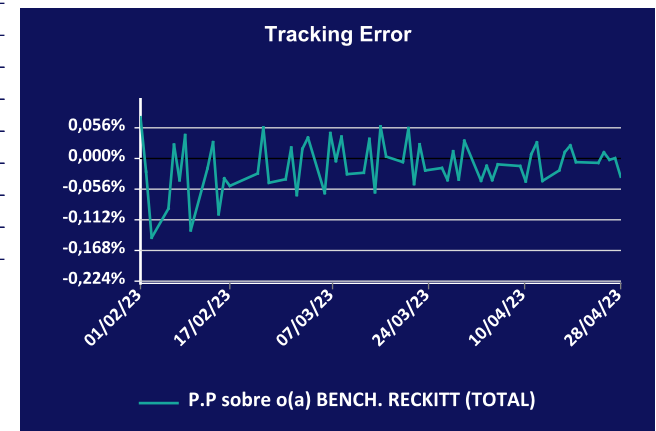
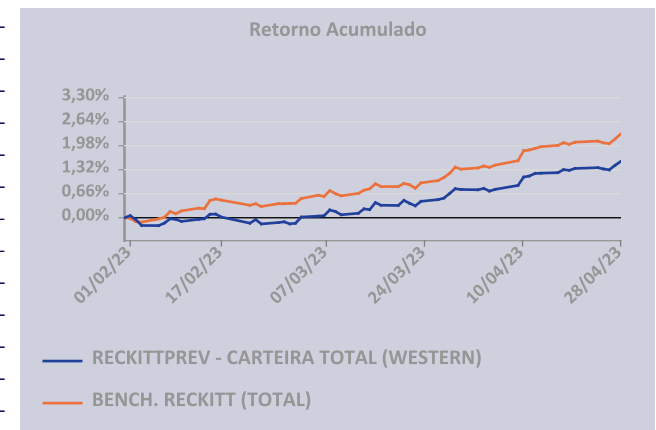
ESTILO: 60,53% | SELEÇÃO: 39,47%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0247%	--
RETORNO ACUMULADO	1,5474%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,3039%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7565%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0085%	--
BETA	0,0577	--
MARKET TIMING	-0,3295	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,6133	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	68,1221%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	74,1225%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-4,4643	--
JENSEN	-0,8409%	--
MODIGLIANI	-9,1391%	--
SHARPE	-0,2884	--
SORTINO	-0,3298	--
TREYNOR	-0,0044	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,4832	--
DOWNSIDE RISK	0,0749%	--
RISCO ATIVO	0,0447%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,7102%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0539%	--
RISCO TOTAL	0,0856%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3603%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	3
MAIOR RETORNO MENSAL	0,8916%(03/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,1128%(02/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,76%	1,22%	8,35%	8,87%	22,56%	0,23% (11/04/2023)	-0,17% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	3,72%	11,62%	16,88%	30,80%	0,27% (11/04/2023)	-0,14% (22/02/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,29% (23/03/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,30% (23/03/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)

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: 2,45593
 PATRIMÔNIO: 143.337.620,57

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	89,05%	IBX	0,11%
IVBX-2	0,00%	SMLL	1,11%
IDIV	5,03%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	2,42%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	2,28%

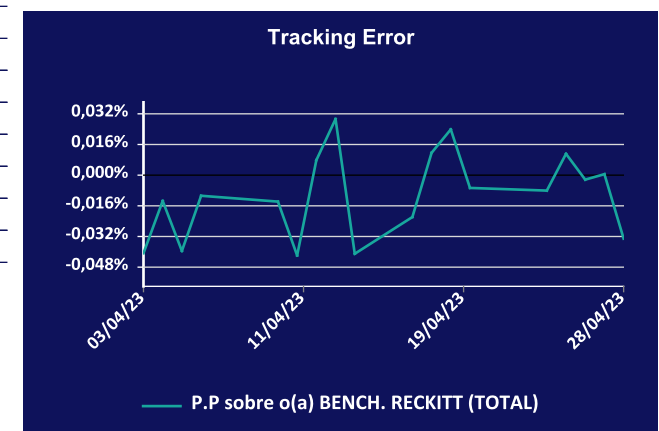
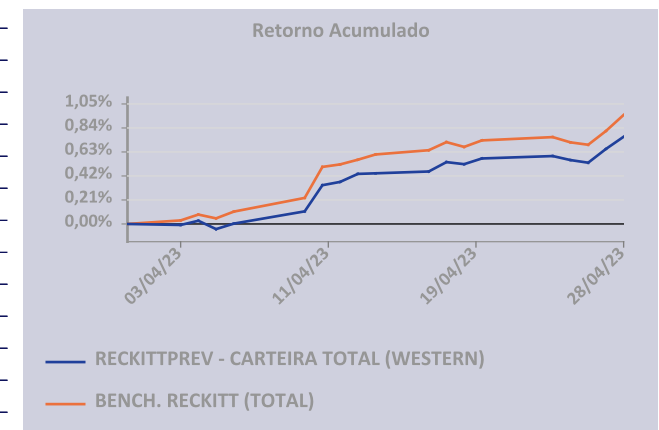
ESTILO: 83,03% | SELEÇÃO: 16,97%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0084%	--
RETORNO ACUMULADO	0,7636%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9540%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1903%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0114%	--
BETA	0,0469	--
MARKET TIMING	-0,0035	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,7744	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	75,7042%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9895%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	0,9832%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-7,4071	--
JENSEN	-0,2019%	--
MODIGLIANI	-3,9168%	--
SHARPE	-0,1208	--
SORTINO	-0,1773	--
TREYNOR	-0,0018	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,7701	--
DOWNSIDE RISK	0,0478%	--
RISCO ATIVO	0,0224%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,3570%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0333%	--
RISCO TOTAL	0,0702%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,1151%	--

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	0,7637%(04/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7637%(04/2023)



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	0,76%	1,22%	8,35%	8,87%	22,56%	0,23% (11/04/2023)	-0,07% (05/04/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,95%	3,72%	11,62%	16,88%	30,80%	0,27% (11/04/2023)	-0,05% (25/04/2023)
CDI	0,92%	4,20%	13,38%	21,45%	24,05%	0,05% (03/04/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	2,50%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	4,29% (11/04/2023)	-2,12% (19/04/2023)
IBX	1,93%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	4,29% (11/04/2023)	-2,14% (19/04/2023)
IVBX-2	1,49%	-7,07%	-14,41%	-31,46%	-3,51%	4,40% (11/04/2023)	-1,73% (19/04/2023)
SMLL	1,91%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	4,63% (11/04/2023)	-2,73% (19/04/2023)
IDIV	3,89%	-0,36%	2,52%	6,38%	45,77%	3,20% (11/04/2023)	-1,47% (19/04/2023)
IRF-M	1,10%	5,03%	12,91%	14,29%	16,50%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA B 5	0,90%	5,33%	9,67%	20,04%	30,74%	0,21% (11/04/2023)	-0,10% (28/04/2023)
IMA B 5+	3,03%	6,75%	8,12%	8,09%	19,22%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
DÓLAR PTAX	-1,57%	-4,16%	1,66%	-7,46%	-7,86%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)