



Avaliação de Performance: RECKITT PREV
Plano de Benefícios

Maio/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 10,94%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 8,93%, 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. Por outro lado, o desempenho mensal agradou. O histórico construído em períodos mais longos, a despeito do ocorrido no mês em análise, não correspondeu às expectativas da Reckitt Prev. 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 poderia ter sido melhor. O retorno acumulado, pouco inferior ao “benchmark” proposto, foi o 22º 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 maio, há indícios de sucesso na seleção dos ativos, alfa obtido com baixa significância estatística, e de insucesso em “timing”. O histórico dos últimos doze meses, bem como o de períodos mais longos, deixou a desejar. 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 também desagradou. Como já é sabido, a Reckitt Prev tem avançado nas discussões quanto a substituição da Western neste segmento de aplicação, suportada pelo estudo de seleção de gestores elaborado pela PPS, entregue no final de jun/22.

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

- CARTEIRA EXTERIOR (WESTERN): Os recursos alocados nesta carteira encontram-se investidos em dois fundos. O Western Asset Macro Opportunities, sem exposição à variação cambial, cujo objetivo é maximizar o retorno total em relação a uma meta de volatilidade entre 8% e 10% ao ano, utilizando-se de estratégias no mercado de renda fixa global; e o Western Asset FIA BDR Nível I, com exposição à variação cambial, cujo objetivo é buscar um retorno absoluto, procurando entregar 4% ao ano em adição à performance do índice S&P 500 (em R\$), utilizando-se de estratégias ativas em relação a composição desse índice, através de uma carteira diversificada de recibos de ações de empresas americanas, negociados no Brasil. Nos últimos doze meses, a performance percebida pelos investimentos no exterior da Entidade registrou rendimento bem superior ao do índice de referência (“benchmark”) estabelecido em sua Política de Investimentos. O desempenho mensal também atendeu às expectativas. Diante do exposto, apesar 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 foi muito bom, uma vez que seu rendimento superou à variação exibida pelo “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. 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 – MAIO DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	29.487.093,35	16,98%
Renda Fixa (Ativa)	112.565.032,09	64,81%
Renda Variável	8.468.358,90	4,87%
Estruturado	13.699.926,51	7,89%
Exterior	9.468.904,69	5,45%
Total	173.689.315,54	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)*

Maio/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: 5,31112
 PATRIMÔNIO: 29.487.093,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,99%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,80%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,20%

ESTILO: 0,62%

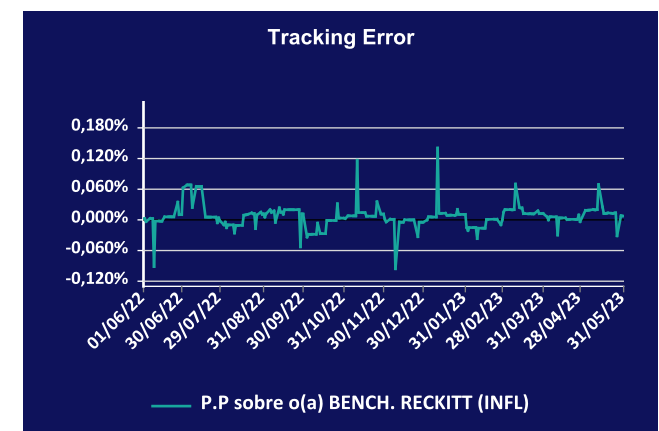
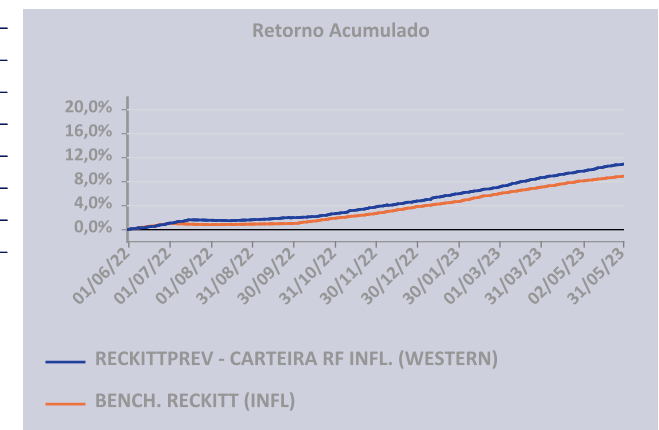
SELEÇÃO: 99,38%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0090%	--
RETORNO ACUMULADO	10,9375%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	8,9283%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	2,0091%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,3417	--
SORTINO	-0,3676	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	11,2609	--
DOWNSIDE RISK	0,0245%	--
RISCO ATIVO	0,0235%	--
RISCO TOTAL	0,0265%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4206%	--

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	1,4828%(03/2023)
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	1,12%	5,88%	10,94%	31,31%	48,09%	0,18% (10/01/2023)	-0,05% (28/09/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,77%	4,90%	8,93%	27,98%	46,34%	0,07% (01/02/2023)	-0,01% (05/07/2022)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,05% (01/02/2023)	-0,03% (05/07/2022)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,04% (01/02/2023)	-0,03% (07/07/2022)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	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: 5,31112
 PATRIMÔNIO: 29.487.093,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,38%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,40%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,13%	DÓLAR PTAX	0,09%

ESTILO: 3,33%

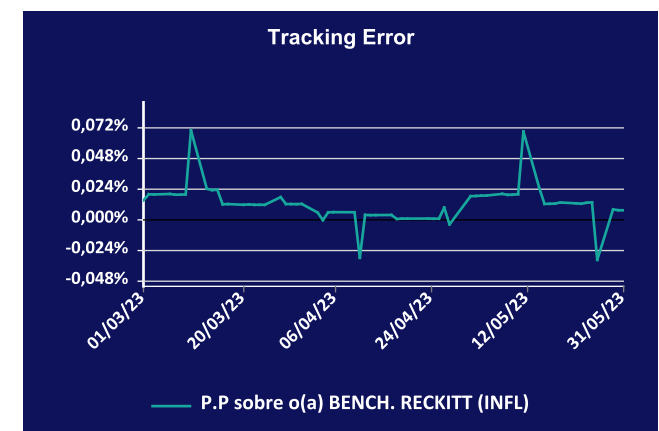
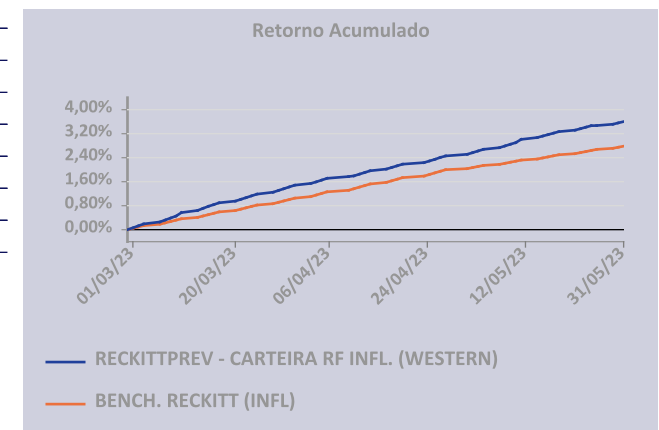
SELEÇÃO: 96,67%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0054%	--
RETORNO ACUMULADO	3,6026%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,7837%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,8189%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,3857	--
SORTINO	0,7450	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	9,8263	--
DOWNSIDE RISK	0,0072%	--
RISCO ATIVO	0,0146%	--
RISCO TOTAL	0,0140%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2225%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
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	1,12%	5,88%	10,94%	31,31%	48,09%	0,12% (10/03/2023)	0,00% (26/05/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,77%	4,90%	8,93%	27,98%	46,34%	0,05% (03/04/2023)	0,03% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	0,53% (09/03/2023)	-0,36% (19/04/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,26% (13/03/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,28% (09/03/2023)	-0,16% (19/04/2023)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,03% (03/04/2023)	0,01% (02/05/2023)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,03% (03/04/2023)	0,02% (02/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)

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: 5,31112
 PATRIMÔNIO: 29.487.093,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	94,60%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	4,29%	IMA B 5+	1,11%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 15,76%

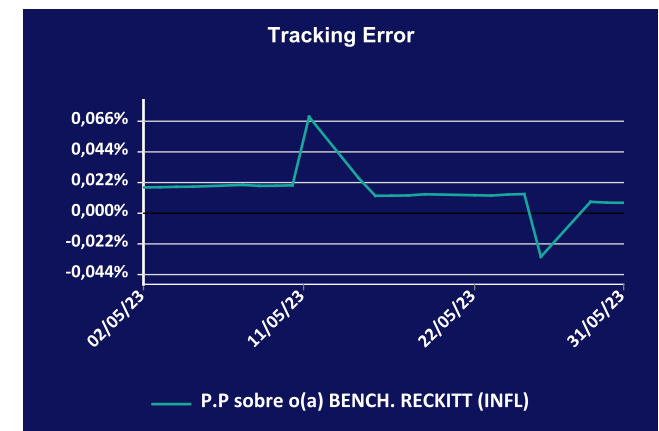
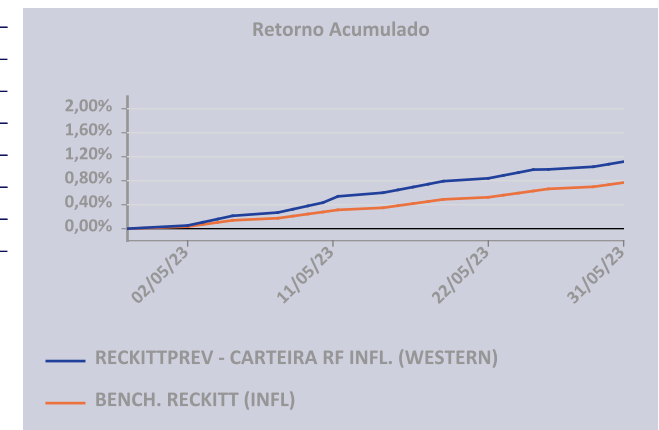
SELEÇÃO: 84,24%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0002%	--
RETORNO ACUMULADO	1,1176%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,7688%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,3487%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0156	--
SORTINO	-0,0237	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	8,6181	--
DOWNSIDE RISK	0,0106%	--
RISCO ATIVO	0,0162%	--
RISCO TOTAL	0,0162%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2573%	--

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	1,1177%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,1177%(05/2023)



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	1,12%	5,88%	10,94%	31,31%	48,09%	0,10% (12/05/2023)	0,00% (26/05/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,77%	4,90%	8,93%	27,98%	46,34%	0,03% (02/05/2023)	0,03% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,26% (11/05/2023)	-0,07% (09/05/2023)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (19/05/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	0,44% (12/05/2023)	-0,26% (16/05/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,19% (04/05/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,76% (12/05/2023)	-0,37% (16/05/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,21% (04/05/2023)	-0,08% (16/05/2023)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,01% (02/05/2023)	0,01% (02/05/2023)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,02% (02/05/2023)	0,02% (02/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,28% (30/05/2023)	-0,93% (12/05/2023)



Agrupamento: Renda Fixa
ÍNDICES (PPS)

Maio/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: 2,96839
 PATRIMÔNIO: 112.565.032,09

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	78,56%	IRF-M	12,71%
IMA B 5	7,55%	IMA B 5+	0,66%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,52%

ESTILO: 13,15%

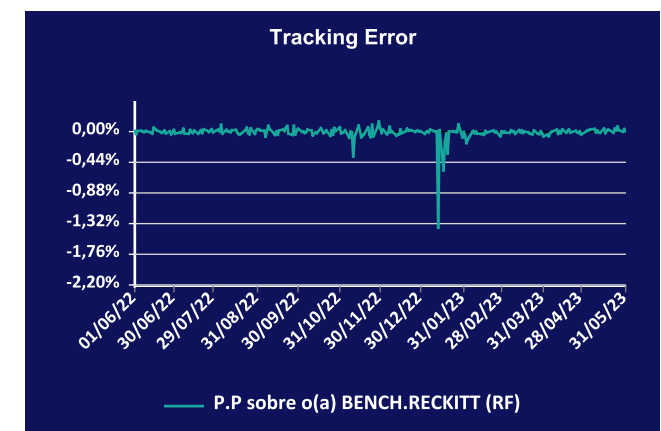
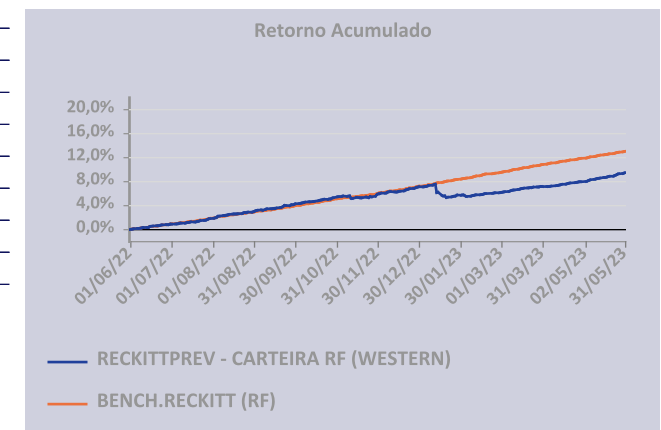
SELEÇÃO: 86,85%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0141%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	9,5063%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,0738%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,5675%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,9272	10° de 15
SHARPE	-0,1301	14° de 15
SORTINO	-0,1350	13° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	118,7495	--
DOWNSIDE RISK	0,1048%	2° de 15
RISCO ATIVO	0,1047%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1086%	5° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7255%	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	1,4158%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,2682%(01/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,42%	2,20%	9,51%	17,30%	21,15%	0,24% (29/11/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,07%	5,43%	13,07%	23,34%	28,48%	0,10% (04/08/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,05% (01/02/2023)	-0,03% (05/07/2022)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,04% (01/02/2023)	-0,03% (07/07/2022)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	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: 2,96839
 PATRIMÔNIO: 112.565.032,09

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	83,47%	IRF-M	4,09%
IMA B 5	10,68%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,77%

ESTILO: 35,86%

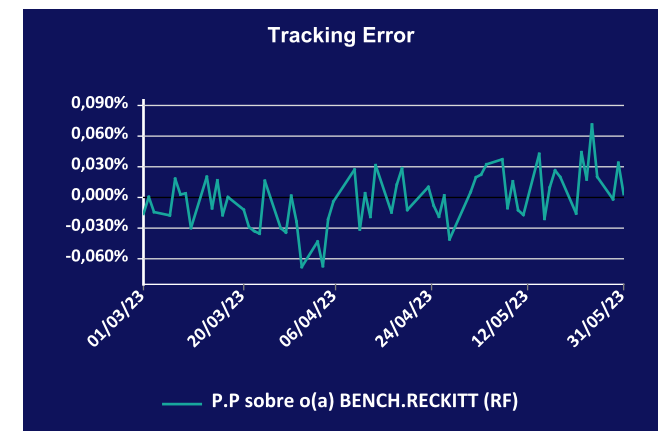
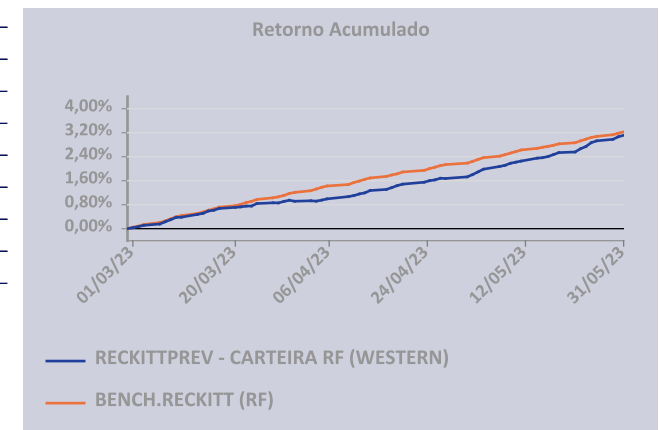
SELEÇÃO: 64,14%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0021%	12° de 15
RETORNO ACUMULADO	3,1133%	12° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2277%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1143%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,0462	11° de 15
SHARPE	-0,0709	14° de 15
SORTINO	-0,0948	13° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,0651	--
DOWNSIDE RISK	0,0221%	14° de 15
RISCO ATIVO	0,0266%	6° de 15
RISCO TOTAL	0,0296%	14° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4711%	14° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,4158%(05/2023)
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	1,42%	2,20%	9,51%	17,30%	21,15%	0,12% (25/05/2023)	-0,03% (31/03/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,07%	5,43%	13,07%	23,34%	28,48%	0,07% (13/03/2023)	0,03% (17/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (28/04/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	0,53% (09/03/2023)	-0,36% (19/04/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,26% (13/03/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,28% (09/03/2023)	-0,16% (19/04/2023)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,03% (03/04/2023)	0,01% (02/05/2023)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,03% (03/04/2023)	0,02% (02/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)

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: 2,96839
 PATRIMÔNIO: 112.565.032,09

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	72,83%	IRF-M	7,35%
IMA B 5	18,43%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,39%

ESTILO: 56,25%

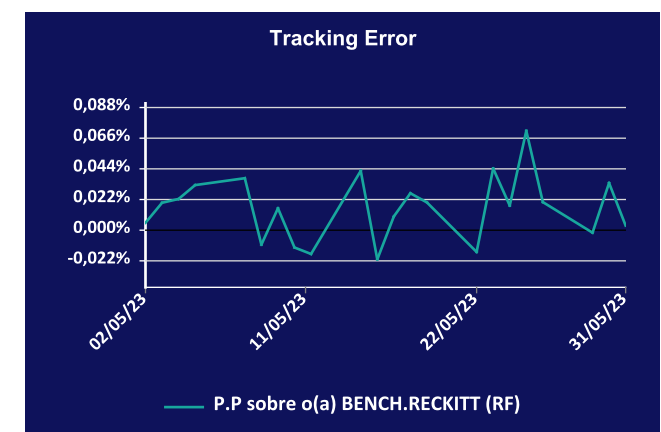
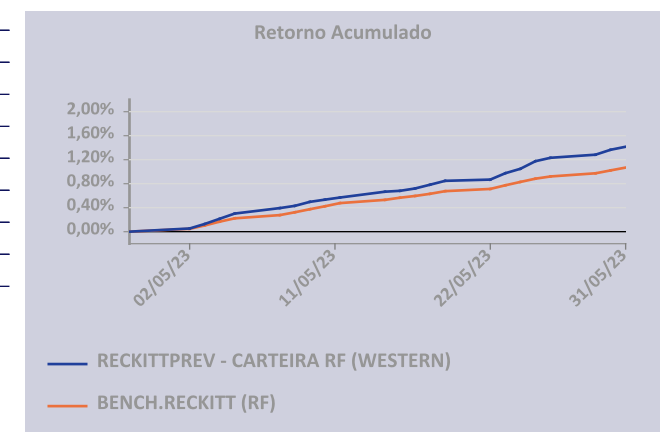
SELEÇÃO: 43,75%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0131%	5° de 15
RETORNO ACUMULADO	1,4158%	5° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0681%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,3476%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	10,6518	2° de 15
SHARPE	0,4692	3° de 15
SORTINO	1,1344	2° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,5201	--
DOWNSIDE RISK	0,0115%	14° de 15
RISCO ATIVO	0,0232%	5° de 15
RISCO TOTAL	0,0280%	13° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4445%	13° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	1,4158%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,4158%(05/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,42%	2,20%	9,51%	17,30%	21,15%	0,12% (25/05/2023)	0,01% (16/05/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,07%	5,43%	13,07%	23,34%	28,48%	0,06% (04/05/2023)	0,03% (17/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,26% (11/05/2023)	-0,07% (09/05/2023)
IMA-S	1,21%	5,44%	13,72%	23,36%	25,52%	0,07% (12/05/2023)	0,04% (19/05/2023)
IMA-B	2,53%	8,76%	10,47%	15,54%	26,13%	0,44% (12/05/2023)	-0,26% (16/05/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,19% (04/05/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,76% (12/05/2023)	-0,37% (16/05/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,21% (04/05/2023)	-0,08% (16/05/2023)
IPCA	0,23%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%	0,01% (02/05/2023)	0,01% (02/05/2023)
INPC	0,36%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%	0,02% (02/05/2023)	0,02% (02/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,28% (30/05/2023)	-0,93% (12/05/2023)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/06/2022 A 31/05/2023
 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	1,2665	12,8106%	-0,0257	1,4343%	0,77%	95.119.064,61	251
2	CLIENTE V - SANTANDER	-0,3922	13,1218%	-0,0596	0,3366%	0,20%	628.843.021,82	251
3	CLIENTE V - BRADESCO	-0,4781	12,1736%	-0,0328	2,1924%	0,34%	261.676.237,31	251
4	CLIENTE V - ITAÚ	-0,6852	12,3233%	-0,0349	1,8310%	0,38%	317.252.215,70	251
5	CLIENTE X - ITAU	-0,9004	12,0464%	-0,0639	1,2521%	0,13%	1.088.569.969,97	251
6	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-1,3578	11,7845%	-0,0697	1,3608%	0,10%	1.029.581.581,64	251
7	CLIENTE Y - BNP	-1,4026	11,3947%	-0,0966	1,2116%	0,16%	273.223.276,40	251
8	CLIENTE D - WESTERN	-1,5583	10,4405%	-0,0897	1,9042%	0,00%	250.851.332,22	251
9	CLIENTE X - BRADESCO	-1,6882	13,8742%	0,0416	0,5282%	0,13%	957.864.643,54	251
10	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,9272	9,5063%	-0,1301	1,7255%	0,35%	112.565.032,09	251
11	CLIENTE Y - WESTERN	-2,1451	11,1336%	-0,1352	0,9760%	0,10%	254.151.273,08	251
12	CLIENTE V - WESTERN	-2,2652	8,5787%	-0,1142	2,4301%	0,38%	91.888.097,46	251
13	CLIENTE X - WESTERN	-2,3233	11,7394%	-0,0897	1,0859%	0,10%	661.687.704,58	251
14	CLIENTE O - BRADESCO	-2,9459	13,5609%	0,0082	0,5573%	0,18%	354.556.335,06	251
15	CLIENTE O - SANTANDER	-3,7098	11,7671%	-0,1275	0,7530%	0,18%	250.363.598,52	251
	MÉDIA:	-1,5009	11,7504%	-0,0680	1,3053%		441.879.558,93	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/05/2023
 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	2,9108	3,3755%	0,0481	0,6365%	0,18%	354.556.335,06	63
2	CLIENTE V - SANTANDER	2,8776	3,3420%	0,1084	0,2061%	0,20%	628.843.021,82	63
3	CLIENTE V - BRADESCO	1,7978	4,6189%	0,2688	1,2368%	0,34%	261.676.237,31	63
4	CLIENTE V - ITAÚ	1,4830	4,6218%	0,2619	1,2721%	0,38%	317.252.215,70	63
5	CLIENTE Y - BNP	1,2218	3,2778%	0,0092	0,7428%	0,16%	273.223.276,40	63
6	CLIENTE X - ITAU	0,8091	3,5354%	0,0686	1,0175%	0,13%	1.088.569.969,97	63
7	CLIENTE X - BNP PARIBAS	0,4541	3,4198%	0,0633	0,6541%	0,10%	1.029.581.581,64	63
8	CLIENTE M - BAHIA	0,3537	3,2600%	0,0026	1,0223%	0,77%	95.119.064,61	63
9	CLIENTE D - WESTERN	0,2912	4,3061%	0,2718	0,9446%	0,00%	250.851.332,22	63
10	CLIENTE X - BRADESCO	0,2863	3,4055%	0,0648	0,5845%	0,13%	957.864.643,54	63
11	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,0463	3,1134%	-0,0710	0,4711%	0,35%	112.565.032,09	63
12	CLIENTE X - WESTERN	-1,1433	3,0298%	-0,0427	1,2516%	0,10%	661.687.704,58	63
13	CLIENTE O - SANTANDER	-1,3270	3,0802%	-0,0700	0,5935%	0,18%	250.363.598,52	63
14	CLIENTE V - WESTERN	-2,3983	4,1236%	0,1841	1,1556%	0,38%	91.888.097,46	63
15	CLIENTE Y - WESTERN	-2,4541	3,0896%	-0,0785	0,4998%	0,10%	254.151.273,08	63
	MÉDIA:	0,2744	3,5733%	0,0726	0,8193%		441.879.558,93	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2023 A 31/05/2023
 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 - SANTANDER	13,9416	1,2102%	0,3684	0,1683%	0,20%	628.843.021,82	22
2	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	10,6519	1,4158%	0,4692	0,4446%	0,35%	112.565.032,09	22
3	CLIENTE D - WESTERN	10,4659	1,8245%	0,6304	0,7918%	0,00%	250.851.332,22	22
4	CLIENTE V - WESTERN	10,0314	1,9134%	0,4972	1,1311%	0,38%	91.888.097,46	22
5	CLIENTE X - WESTERN	9,7418	1,1339%	0,0209	0,3623%	0,10%	661.687.704,58	22
6	CLIENTE Y - WESTERN	8,3720	1,0710%	-0,0770	0,4839%	0,10%	254.151.273,08	22
7	CLIENTE X - BRADESCO	8,0584	1,2389%	0,1489	0,5547%	0,13%	957.864.643,54	22
8	CLIENTE O - BRADESCO	7,4953	1,2074%	0,0939	0,6407%	0,18%	354.556.335,06	22
9	CLIENTE O - SANTANDER	7,0471	1,2248%	0,1208	0,6005%	0,18%	250.363.598,52	22
10	CLIENTE V - ITAÚ	6,6262	1,7112%	0,3771	1,1109%	0,38%	317.252.215,70	22
11	CLIENTE V - BRADESCO	6,4086	1,7092%	0,3549	1,1766%	0,34%	261.676.237,31	22
12	CLIENTE X - ITAU	5,2421	1,3317%	0,1760	0,8458%	0,13%	1.088.569.969,97	22
13	CLIENTE X - BNP PARIBAS	3,5027	1,1215%	-0,0022	0,5517%	0,10%	1.029.581.581,64	22
14	CLIENTE Y - BNP	2,0302	0,9920%	-0,1615	0,5801%	0,16%	273.223.276,40	22
15	CLIENTE M - BAHIA	-0,3902	0,7288%	-0,3422	0,8241%	0,77%	95.119.064,61	22
	MÉDIA:	7,2817	1,3223%	0,1783	0,6845%		441.879.558,93	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/06/2022 A 31/05/2023
 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	13,8742%	0,0416	0,0014%	0,5282%	0,13%	957.864.643,54	251
2	CLIENTE O - BRADESCO	13,5609%	0,0082	0,0003%	0,5573%	0,18%	354.556.335,06	251
3	CLIENTE V - SANTANDER	13,1218%	-0,0596	-0,0013%	0,3366%	0,20%	628.843.021,82	251
4	CLIENTE M - BAHIA	12,8106%	-0,0257	-0,0023%	1,4343%	0,77%	95.119.064,61	251
5	CLIENTE V - ITAÚ	12,3233%	-0,0349	-0,0040%	1,8310%	0,38%	317.252.215,70	251
6	CLIENTE V - BRADESCO	12,1736%	-0,0328	-0,0045%	2,1924%	0,34%	261.676.237,31	251
7	CLIENTE X - ITAU	12,0464%	-0,0639	-0,0050%	1,2521%	0,13%	1.088.569.969,97	251
8	CLIENTE X - BNP PARIBAS	11,7845%	-0,0697	-0,0060%	1,3608%	0,10%	1.029.581.581,64	251
9	CLIENTE O - SANTANDER	11,7671%	-0,1275	-0,0061%	0,7530%	0,18%	250.363.598,52	251
10	CLIENTE X - WESTERN	11,7394%	-0,0897	-0,0061%	1,0859%	0,10%	661.687.704,58	251
11	CLIENTE Y - BNP	11,3947%	-0,0966	-0,0074%	1,2116%	0,16%	273.223.276,40	251
12	CLIENTE Y - WESTERN	11,1336%	-0,1352	-0,0083%	0,9760%	0,10%	254.151.273,08	251
13	CLIENTE D - WESTERN	10,4405%	-0,0897	-0,0108%	1,9042%	0,00%	250.851.332,22	251
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	9,5063%	-0,1301	-0,0142%	1,7255%	0,35%	112.565.032,09	251
15	CLIENTE V - WESTERN	8,5787%	-0,1142	-0,0175%	2,4301%	0,38%	91.888.097,46	251
	MÉDIA:	11,7504%	-0,0680	-0,0061%	1,3053%		441.879.558,93	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/05/2023
 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

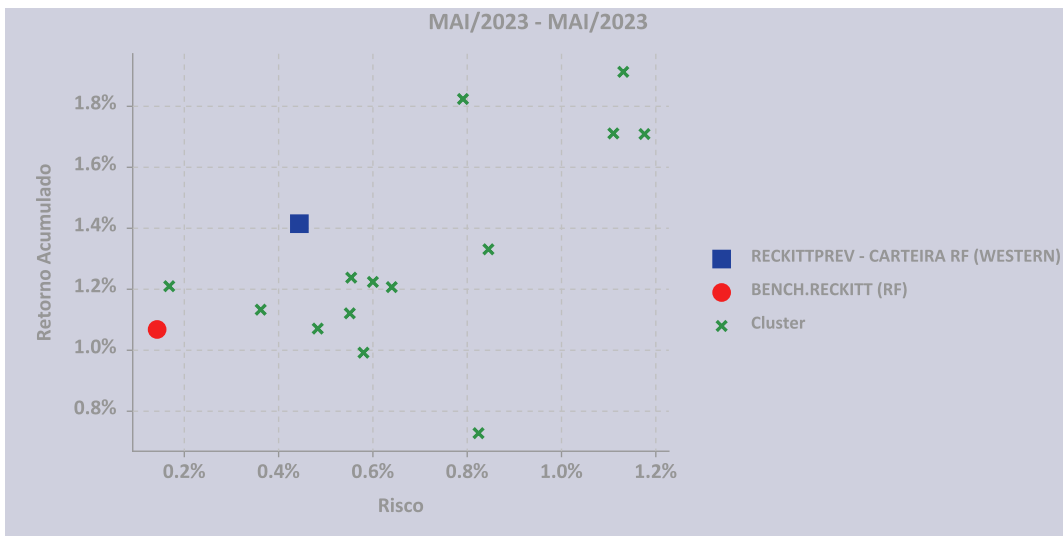
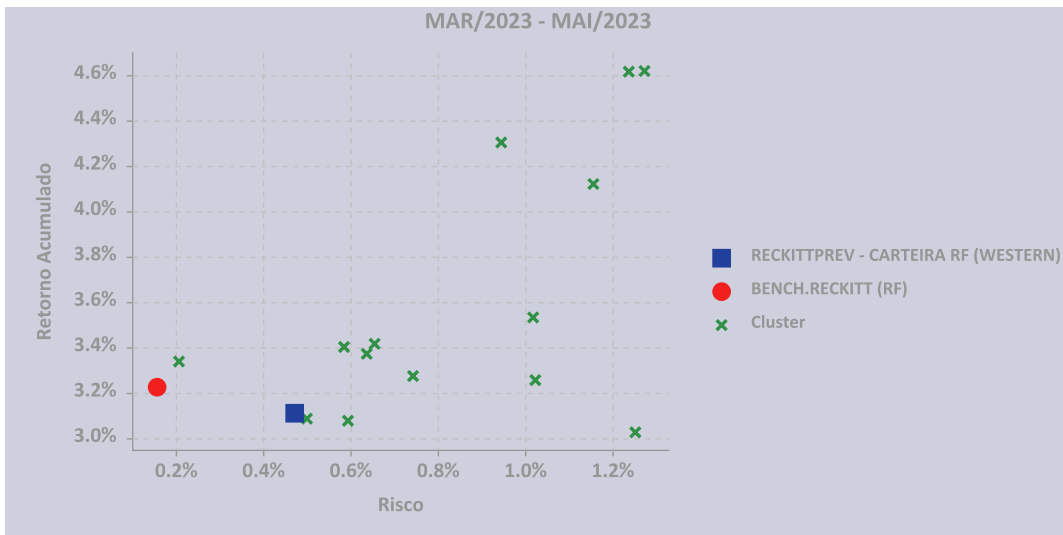
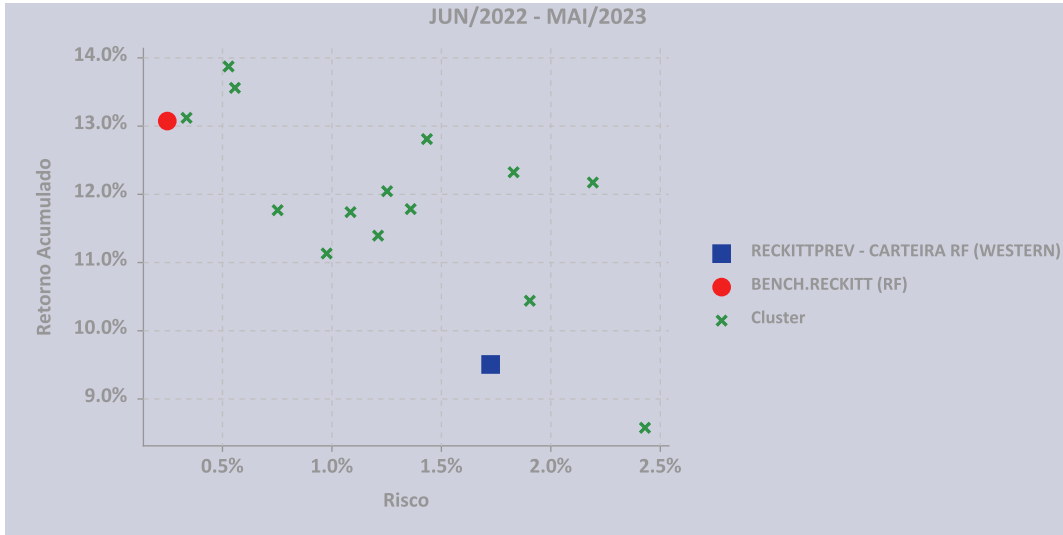
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE V - ITAÚ	4,6218%	0,2619	0,0210%	1,2721%	0,38%	317.252.215,70	63
2	CLIENTE V - BRADESCO	4,6189%	0,2688	0,0209%	1,2368%	0,34%	261.676.237,31	63
3	CLIENTE D - WESTERN	4,3061%	0,2718	0,0162%	0,9446%	0,00%	250.851.332,22	63
4	CLIENTE V - WESTERN	4,1236%	0,1841	0,0134%	1,1556%	0,38%	91.888.097,46	63
5	CLIENTE X - ITAU	3,5354%	0,0686	0,0044%	1,0175%	0,13%	1.088.569.969,97	63
6	CLIENTE X - BNP PARIBAS	3,4198%	0,0633	0,0026%	0,6541%	0,10%	1.029.581.581,64	63
7	CLIENTE X - BRADESCO	3,4055%	0,0648	0,0024%	0,5845%	0,13%	957.864.643,54	63
8	CLIENTE O - BRADESCO	3,3755%	0,0481	0,0019%	0,6365%	0,18%	354.556.335,06	63
9	CLIENTE V - SANTANDER	3,3420%	0,1084	0,0014%	0,2061%	0,20%	628.843.021,82	63
10	CLIENTE Y - BNP	3,2778%	0,0092	0,0004%	0,7428%	0,16%	273.223.276,40	63
11	CLIENTE M - BAHIA	3,2600%	0,0026	0,0002%	1,0223%	0,77%	95.119.064,61	63
12	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	3,1134%	-0,0710	-0,0021%	0,4711%	0,35%	112.565.032,09	63
13	CLIENTE Y - WESTERN	3,0896%	-0,0785	-0,0025%	0,4998%	0,10%	254.151.273,08	63
14	CLIENTE O - SANTANDER	3,0802%	-0,0700	-0,0026%	0,5935%	0,18%	250.363.598,52	63
15	CLIENTE X - WESTERN	3,0298%	-0,0427	-0,0034%	1,2516%	0,10%	661.687.704,58	63
	MÉDIA:	3,5733%	0,0726	0,0050%	0,8193%		441.879.558,93	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2023 A 31/05/2023
 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 - WESTERN	1,9134%	0,4972	0,0354%	1,1311%	0,38%	91.888.097,46	22
2	CLIENTE D - WESTERN	1,8245%	0,6304	0,0314%	0,7918%	0,00%	250.851.332,22	22
3	CLIENTE V - ITAÚ	1,7112%	0,3771	0,0264%	1,1109%	0,38%	317.252.215,70	22
4	CLIENTE V - BRADESCO	1,7092%	0,3549	0,0263%	1,1766%	0,34%	261.676.237,31	22
5	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	1,4158%	0,4692	0,0131%	0,4446%	0,35%	112.565.032,09	22
6	CLIENTE X - ITAÚ	1,3317%	0,1760	0,0094%	0,8458%	0,13%	1.088.569.969,97	22
7	CLIENTE X - BRADESCO	1,2389%	0,1489	0,0052%	0,5547%	0,13%	957.864.643,54	22
8	CLIENTE O - SANTANDER	1,2248%	0,1208	0,0046%	0,6005%	0,18%	250.363.598,52	22
9	CLIENTE V - SANTANDER	1,2102%	0,3684	0,0039%	0,1683%	0,20%	628.843.021,82	22
10	CLIENTE O - BRADESCO	1,2074%	0,0939	0,0038%	0,6407%	0,18%	354.556.335,06	22
11	CLIENTE X - WESTERN	1,1339%	0,0209	0,0005%	0,3623%	0,10%	661.687.704,58	22
12	CLIENTE X - BNP PARIBAS	1,1215%	-0,0022	-0,0001%	0,5517%	0,10%	1.029.581.581,64	22
13	CLIENTE Y - WESTERN	1,0710%	-0,0770	-0,0023%	0,4839%	0,10%	254.151.273,08	22
14	CLIENTE Y - BNP	0,9920%	-0,1615	-0,0059%	0,5801%	0,16%	273.223.276,40	22
15	CLIENTE M - BAHIA	0,7288%	-0,3422	-0,0178%	0,8241%	0,77%	95.119.064,61	22
	MÉDIA:	1,3223%	0,1783	0,0089%	0,6845%		441.879.558,93	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Maio/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: 1,90600
 PATRIMÔNIO: 8.468.358,90

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	90,24%
	IVBX-2	6,12%	SMLL	0,92%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	2,72%		

ESTILO: 98,84%

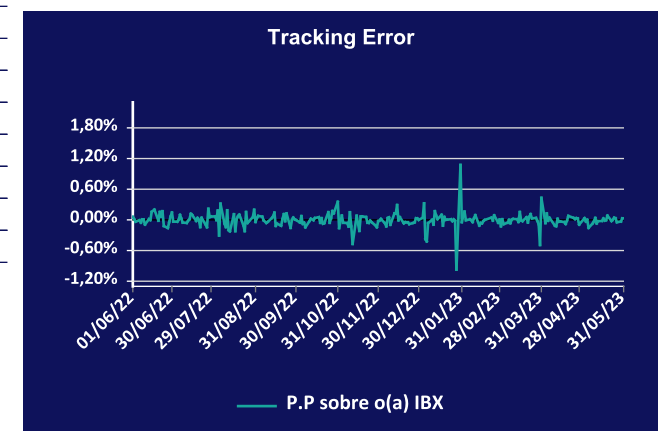
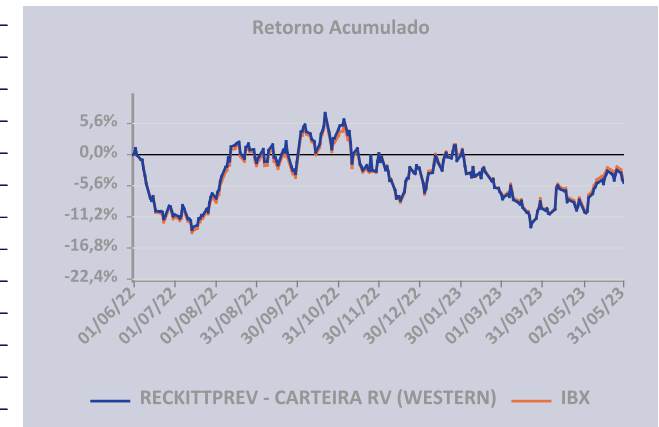
SELEÇÃO: 1,16%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0622%	31° de 33
RETORNO ACUMULADO	-5,0237%	31° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-4,4650%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5586%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0033%	12° de 33
BETA	0,9775	26° de 33
MARKET TIMING	-0,4064	30° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9885	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	24,9331%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	82,4517%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2896	31° de 33
JENSEN	-0,9752%	31° de 33
MODIGLIANI	-0,8890%	31° de 33
SHARPE	-0,0472	31° de 33
SORTINO	-0,0649	31° de 33
TREYNOR	-0,0006	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	22,6934	--
DOWNSIDE RISK	0,9595%	16° de 33
RISCO ATIVO	0,1448%	8° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,2992%	8° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1414%	8° de 33
RISCO TOTAL	1,3187%	23° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	20,9345%	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	3,40%	-2,70%	-5,02%	-19,46%	15,30%	5,54% (03/10/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	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: 1,90600
 PATRIMÔNIO: 8.468.358,90

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	0,20%	IBX	87,75%
	IVBX-2	4,89%	SMLL	0,00%
	IDIV	3,51%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	3,64%		

ESTILO: 99,44%

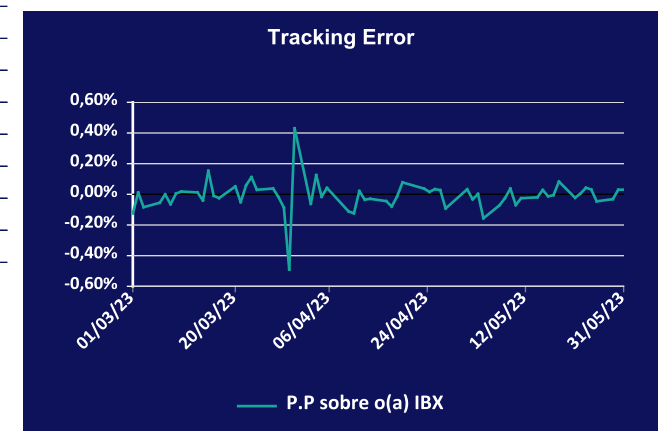
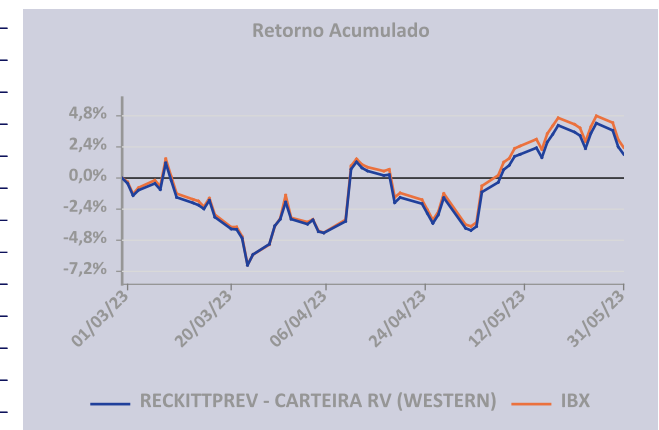
SELEÇÃO: 0,56%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0157%	20° de 33
RETORNO ACUMULADO	1,8336%	20° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,3565%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5229%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0099%	22° de 33
BETA	0,9558	29° de 33
MARKET TIMING	0,0718	4° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9938	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	55,8314%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	12,5320%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,3510	18° de 33
JENSEN	-0,5618%	20° de 33
MODIGLIANI	-0,5828%	20° de 33
SHARPE	-0,0140	20° de 33
SORTINO	-0,0213	20° de 33
TREYNOR	-0,0001	20° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	13,8293	--
DOWNSIDE RISK	0,7404%	31° de 33
RISCO ATIVO	0,1017%	8° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,6159%	8° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0881%	9° de 33
RISCO TOTAL	1,1218%	29° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,8085%	29° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	3
MAIOR RETORNO MENSAL	3,4019%(05/2023)
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	3,40%	-2,70%	-5,02%	-19,46%	15,30%	4,16% (11/04/2023)	-2,39% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	4,29% (11/04/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	4,29% (11/04/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	4,40% (11/04/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	3,20% (11/04/2023)	-2,04% (02/05/2023)

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: 1,90600
 PATRIMÔNIO: 8.468.358,90

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	0,09%	IBX	94,03%
	IVBX-2	3,54%	SMLL	0,00%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	2,33%		

ESTILO: 99,87%

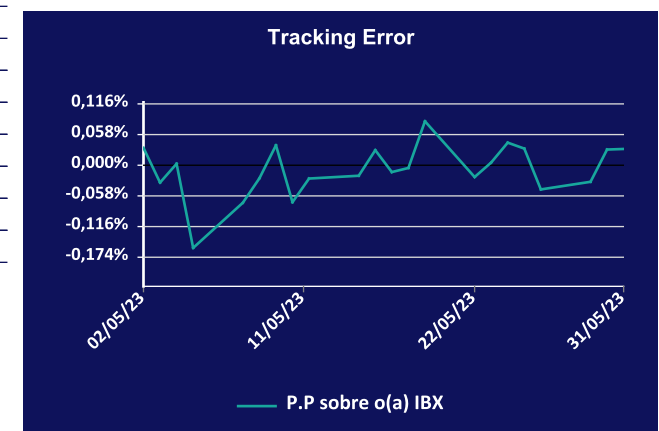
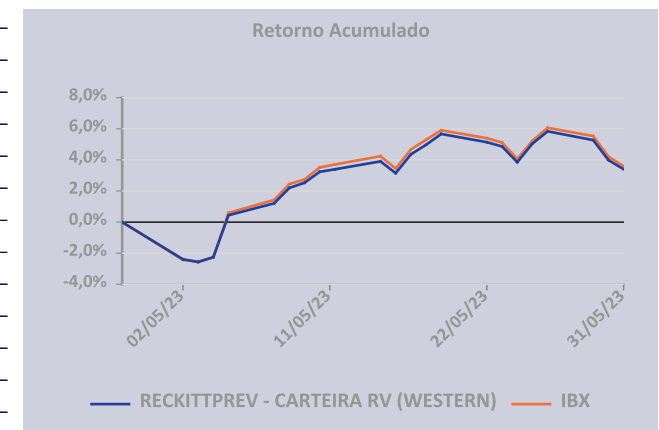
SELEÇÃO: 0,13%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,1066%	22° de 33
RETORNO ACUMULADO	3,4019%	22° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,5934%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1915%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0031%	11° de 33
BETA	0,9732	26° de 33
MARKET TIMING	-0,7778	26° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9987	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	25,4535%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	91,9360%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,7312	18° de 33
JENSEN	-0,1206%	19° de 33
MODIGLIANI	-0,1259%	19° de 33
SHARPE	0,1014	19° de 33
SORTINO	0,1553	19° de 33
TREYNOR	0,0010	19° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,1238	--
DOWNSIDE RISK	0,6867%	21° de 33
RISCO ATIVO	0,0507%	13° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,8054%	13° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0401%	14° de 33
RISCO TOTAL	1,0510%	26° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	16,6849%	26° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	3,4019%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	3,4019%(05/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	3,40%	-2,70%	-5,02%	-19,46%	15,30%	2,76% (05/05/2023)	-2,39% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	2,91% (05/05/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	2,92% (05/05/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	2,19% (05/05/2023)	-1,46% (02/05/2023)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	3,51% (05/05/2023)	-2,20% (16/05/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	2,41% (05/05/2023)	-2,04% (02/05/2023)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE:	01/06/2022 A 31/05/2023
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	12,0264%	1,0229	7,0803%	23,0397%	1,70%	106.234.787,29	251
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	5,1489%	0,9567	1,0004%	20,7812%	2,00%	296.560.548,68	251
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	5,0291%	0,9543	0,9353%	20,6959%	2,00%	399.110.941,03	251
4	DAHLIA ACOES FC FIA	3,8029%	0,9993	-1,3979%	22,4168%	1,85%	148.651.573,56	251
5	IAJA ACOES FC FIA	2,3527%	0,9890	-2,0365%	21,2047%	0,08%	211.038.949,15	251
6	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	2,2003%	0,8843	-0,7476%	19,2552%	0,41%	349.468.011,83	251
7	IAJA SAM ACOES FI	1,9287%	1,0057	-2,7105%	21,5400%	0,22%	132.449.244,41	251
8	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	1,8781%	0,9311	-1,7171%	20,1548%	0,75%	83.627.143,01	251
9	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,5906%	1,0260	-3,3263%	21,8969%	0,70%	30.012.260,11	251
10	MULTIPREV FIA	1,5754%	0,9837	-2,6429%	20,9871%	0,00%	675.278.850,13	251
11	BRAM FIA IBRX ATIVO	0,9027%	0,9880	-3,3698%	21,0676%	0,00%	356.524.844,53	251
12	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,9003%	1,0055	-3,6617%	21,4295%	0,00%	181.276.860,45	251
13	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	0,8954%	0,9879	-3,3775%	21,0682%	0,00%	357.238.725,15	251
14	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,7570%	0,9892	-3,5346%	21,0932%	0,00%	129.045.108,29	251
15	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,6633%	1,0005	-3,8107%	21,3194%	0,00%	1.075.027.083,52	251
16	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,6157%	0,9696	-3,3681%	20,7166%	0,15%	73.373.548,02	251
17	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,5143%	0,9790	-3,5890%	20,8661%	0,00%	214.015.226,80	251
18	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,4899%	1,0001	-3,9769%	21,3105%	0,15%	178.143.013,74	251
19	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3071%	1,0002	-4,1627%	21,3141%	0,30%	51.939.827,71	251
20	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,2691%	0,9758	-3,7719%	20,7971%	0,30%	34.085.654,62	251
21	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,2660%	0,9781	-3,8172%	20,8482%	0,00%	62.711.956,20	251
22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,2655%	0,9936	-4,0871%	21,1727%	0,15%	158.713.966,86	251
23	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,2184%	0,9957	-4,1715%	21,2180%	0,19%	26.899.982,29	251
24	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,1937%	0,9976	-4,2280%	21,2564%	0,10%	511.196.054,39	251
25	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,1883%	0,9968	-4,2267%	21,2483%	0,56%	64.778.540,12	251
26	BRADESCO FIA SALUBRE	0,0608%	0,9806	-4,0722%	20,9127%	0,50%	128.877.762,62	251
27	COMSHELL CONCHA FIA	0,0225%	0,9859	-4,1915%	21,0099%	0,17%	64.919.092,34	251
28	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,0217%	0,9876	-4,2360%	21,0619%	0,70%	12.117.012,76	251
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,0346%	0,9882	-4,3012%	21,0731%	0,90%	178.649.071,47	251
30	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,6712%	0,9626	-4,4448%	20,5168%	0,75%	31.124.293,29	251
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,8891%	0,9775	-5,0237%	20,9345%	0,35%	8.468.358,90	251
32	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-1,7033%	0,9967	-6,1063%	21,2411%	0,09%	376.747.718,58	251
33	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-1,7305%	0,9957	-6,1135%	21,2195%	0,01%	377.066.546,85	251
	MÉDIA:	1,2138%	0,9844	-3,0668%	21,1111%		214.708.259,35	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/05/2023
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	4,5114%	1,2083	7,9752%	24,2435%	1,70%	106.234.787,29	63
2	DAHLIA ACOES FC FIA	2,0778%	1,0367	4,5139%	19,8097%	1,85%	148.651.573,56	63
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	1,4773%	1,0223	3,8561%	19,2670%	2,00%	399.110.941,03	63
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	1,3322%	1,0246	3,7068%	19,3260%	2,00%	296.560.548,68	63
5	MULTIPREV FIA	0,4165%	0,9977	2,7749%	18,4897%	0,00%	675.278.850,13	63
6	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,1761%	1,0122	2,5245%	18,7736%	0,00%	181.276.860,45	63
7	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,1362%	1,0004	2,4925%	18,5686%	0,00%	1.075.027.083,52	63
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0906%	0,9937	2,4519%	18,4519%	0,15%	158.713.966,86	63
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0863%	1,0005	2,4426%	18,5699%	0,15%	178.143.013,74	63
10	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0450%	1,0004	2,4013%	18,5688%	0,30%	51.939.827,71	63
11	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0446%	0,9976	2,4033%	18,5153%	0,10%	511.196.054,39	63
12	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0022%	0,9976	2,3613%	18,5103%	0,19%	26.899.982,29	63
13	COMSHELL CONCHA FIA	-0,0326%	0,9929	2,3323%	18,3968%	0,17%	64.919.092,34	63
14	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1948%	0,9509	2,2139%	17,6729%	0,30%	34.085.654,62	63
15	IAJA ACOES FC FIA	-0,2103%	0,9700	2,1760%	18,0626%	0,08%	211.038.949,15	63
16	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,2257%	1,0032	2,1294%	18,5870%	0,56%	64.778.540,12	63
17	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,2289%	1,0271	2,0919%	19,1532%	0,70%	30.012.260,11	63
18	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,3380%	0,9766	2,0478%	18,1217%	0,00%	214.015.226,80	63
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,3617%	0,9745	2,0276%	18,0785%	0,00%	62.711.956,20	63
20	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,5829%	0,9559	1,8337%	17,8085%	0,35%	8.468.358,90	63
21	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,6382%	0,9478	1,7999%	17,5759%	0,75%	31.124.293,29	63
22	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,7318%	0,9616	1,6800%	17,9321%	0,15%	73.373.548,02	63
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,9460%	0,9909	1,4269%	18,3977%	0,00%	357.238.725,15	63
24	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,9526%	0,9881	1,4260%	18,3410%	0,00%	356.524.844,53	63
25	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-1,0222%	0,9917	1,3522%	18,3902%	0,00%	129.045.108,29	63
26	BRADESCO FIA SALUBRE	-1,1430%	0,9822	1,2511%	18,2205%	0,50%	128.877.762,62	63
27	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-1,1724%	0,9888	1,2080%	18,3484%	0,70%	12.117.012,76	63
28	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-1,1864%	0,9956	1,1798%	18,4771%	0,09%	376.747.718,58	63
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-1,2008%	0,9884	1,1802%	18,3467%	0,90%	178.649.071,47	63
30	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-1,2050%	0,9948	1,1628%	18,4630%	0,01%	377.066.546,85	63
31	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,2697%	0,9413	1,1921%	17,6599%	0,41%	349.468.011,83	63
32	IAJA SAM ACOES FI	-1,3757%	0,9949	0,9885%	18,5002%	0,22%	132.449.244,41	63
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-2,3175%	0,9188	0,2572%	17,3015%	0,75%	83.627.143,01	63
	MÉDIA:	-0,2103%	0,9948	2,2079%	18,5736%		214.708.259,35	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2023 A 31/05/2023
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	5,1567%	1,0749	9,6457%	19,1808%	1,70%	106.234.787,29	22
2	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	1,3231%	0,9827	4,9309%	17,2303%	2,00%	399.110.941,03	22
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	1,1475%	0,9869	4,7739%	17,3217%	2,00%	296.560.548,68	22
4	DAHLIA ACOES FC FIA	0,9888%	1,0890	5,0236%	19,3552%	1,85%	148.651.573,56	22
5	IAJA ACOES FC FIA	0,4600%	0,9536	3,9289%	16,4359%	0,08%	211.038.949,15	22
6	MULTIPREV FIA	0,0815%	0,9757	3,6099%	16,7278%	0,00%	675.278.850,13	22
7	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0240%	0,9957	3,6062%	17,0878%	0,10%	511.196.054,39	22
8	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,0200%	0,9997	3,6129%	17,1612%	0,00%	1.075.027.083,52	22
9	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0041%	0,9912	3,5763%	17,0184%	0,15%	158.713.966,86	22
10	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0025%	0,9996	3,5952%	17,1597%	0,15%	178.143.013,74	22
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-0,0146%	0,9996	3,5780%	17,1595%	0,30%	51.939.827,71	22
12	IAJA SAM ACOES FI	-0,0415%	0,9839	3,5188%	16,9305%	0,22%	132.449.244,41	22
13	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-0,0442%	0,9975	3,5421%	17,1148%	0,19%	26.899.982,29	22
14	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-0,0458%	1,0187	3,5897%	17,4634%	0,00%	181.276.860,45	22
15	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0467%	0,9476	3,4194%	16,2633%	0,30%	34.085.654,62	22
16	BRAM FIA IBRX ATIVO	-0,0909%	0,9792	3,4525%	16,8042%	0,00%	356.524.844,53	22
17	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-0,0968%	0,9804	3,4502%	16,8292%	0,00%	357.238.725,15	22
18	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1068%	0,9986	3,4780%	17,1022%	0,17%	64.919.092,34	22
19	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,1259%	0,9733	3,4019%	16,6850%	0,35%	8.468.358,90	22
20	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,1348%	0,9749	3,3977%	16,7173%	0,00%	214.015.226,80	22
21	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-0,1533%	0,9843	3,4040%	16,8973%	0,00%	129.045.108,29	22
22	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,1721%	1,0154	3,4562%	17,4255%	0,56%	64.778.540,12	22
23	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,1812%	0,9794	3,3646%	16,8078%	0,90%	178.649.071,47	22
24	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1951%	1,0474	3,5133%	18,0326%	0,70%	30.012.260,11	22
25	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,1958%	0,9743	3,3357%	16,6983%	0,00%	62.711.956,20	22
26	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,2111%	0,9659	3,3047%	16,5750%	0,50%	128.877.762,62	22
27	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,2327%	0,9813	3,3191%	16,8455%	0,70%	12.117.012,76	22
28	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,2850%	0,9450	3,1850%	16,1954%	0,75%	31.124.293,29	22
29	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,2861%	0,9612	3,2304%	16,5601%	0,15%	73.373.548,02	22
30	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,2932%	1,0033	3,3102%	17,2438%	0,09%	376.747.718,58	22
31	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,2989%	1,0026	3,3028%	17,2304%	0,01%	377.066.546,85	22
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-0,4928%	0,9353	2,9873%	16,1812%	0,41%	349.468.011,83	22
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,7828%	0,8911	2,6352%	15,3811%	0,75%	83.627.143,01	22
	MÉDIA:	0,1418%	0,9876	3,7418%	17,0249%		214.708.259,35	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/06/2022 A 31/05/2023
 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	RPS FIC FI ACOES SELECTION	7,0803%	11,9450%	1,0229	23,0397%	1,70%	106.234.787,29	251
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	1,0004%	4,6887%	0,9567	20,7812%	2,00%	296.560.548,68	251
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,9353%	4,5782%	0,9543	20,6959%	2,00%	399.110.941,03	251
4	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-0,7476%	1,6157%	0,8843	19,2552%	0,41%	349.468.011,83	251
5	DAHLIA ACOES FC FIA	-1,3979%	3,0192%	0,9993	22,4168%	1,85%	148.651.573,56	251
6	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-1,7171%	1,4899%	0,9311	20,1548%	0,75%	83.627.143,01	251
7	IAJA ACOES FC FIA	-2,0365%	2,2188%	0,9890	21,2047%	0,08%	211.038.949,15	251
8	MULTIPREV FIA	-2,6429%	1,5234%	0,9837	20,9871%	0,00%	675.278.850,13	251
9	IAJA SAM ACOES FI	-2,7105%	1,8509%	1,0057	21,5400%	0,22%	132.449.244,41	251
10	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,3263%	1,6091%	1,0260	21,8969%	0,70%	30.012.260,11	251
11	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-3,3681%	0,5550%	0,9696	20,7166%	0,15%	73.373.548,02	251
12	BRAM FIA IBRX ATIVO	-3,3698%	0,8806%	0,9880	21,0676%	0,00%	356.524.844,53	251
13	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-3,3775%	0,8730%	0,9879	21,0682%	0,00%	357.238.725,15	251
14	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-3,5346%	0,7371%	0,9892	21,0932%	0,00%	129.045.108,29	251
15	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-3,5890%	0,4977%	0,9790	20,8661%	0,00%	214.015.226,80	251
16	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-3,6617%	0,9023%	1,0055	21,4295%	0,00%	181.276.860,45	251
17	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,7719%	0,2601%	0,9758	20,7971%	0,30%	34.085.654,62	251
18	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-3,8107%	0,6635%	1,0005	21,3194%	0,00%	1.075.027.083,52	251
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-3,8172%	0,2515%	0,9781	20,8482%	0,00%	62.711.956,20	251
20	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-3,9769%	0,4898%	1,0001	21,3105%	0,15%	178.143.013,74	251
21	BRADESCO FIA SALUBRE	-4,0722%	0,0471%	0,9806	20,9127%	0,50%	128.877.762,62	251
22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-4,0871%	0,2632%	0,9936	21,1727%	0,15%	158.713.966,86	251
23	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-4,1627%	0,3070%	1,0002	21,3141%	0,30%	51.939.827,71	251
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-4,1715%	0,2171%	0,9957	21,2180%	0,19%	26.899.982,29	251
25	COMSHELL CONCHA FIA	-4,1915%	0,0201%	0,9859	21,0099%	0,17%	64.919.092,34	251
26	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-4,2267%	0,1785%	0,9968	21,2483%	0,56%	64.778.540,12	251
27	SANTANDER FI IBRX ACOES	-4,2280%	0,1931%	0,9976	21,2564%	0,10%	511.196.054,39	251
28	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-4,2360%	0,0088%	0,9876	21,0619%	0,70%	12.117.012,76	251
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-4,3012%	-0,0462%	0,9882	21,0731%	0,90%	178.649.071,47	251
30	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-4,4448%	-0,6566%	0,9626	20,5168%	0,75%	31.124.293,29	251
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-5,0237%	-0,9752%	0,9775	20,9345%	0,35%	8.468.358,90	251
32	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-6,1063%	-1,7048%	0,9967	21,2411%	0,09%	376.747.718,58	251
33	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-6,1135%	-1,7302%	0,9957	21,2195%	0,01%	377.066.546,85	251
	MÉDIA:	-3,0668%	1,1143%	0,9844	21,1111%		214.708.259,35	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2023 A 31/05/2023
 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

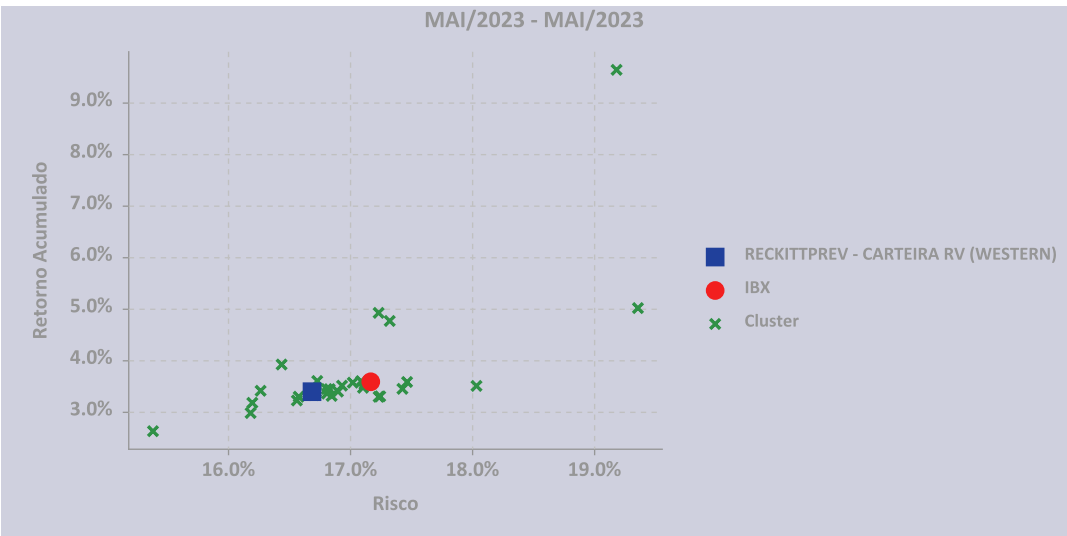
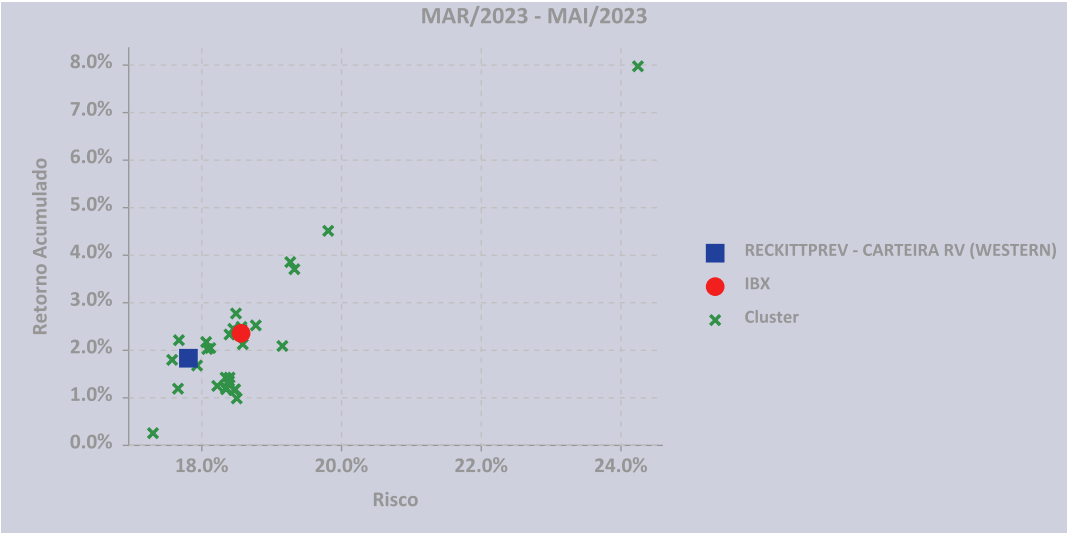
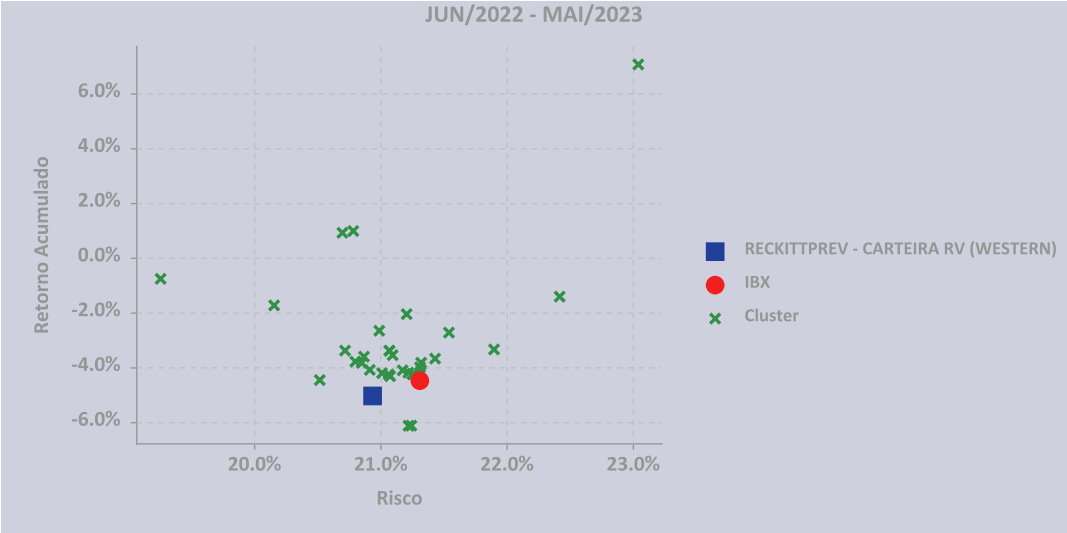
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	RPS FIC FI ACOES SELECTION	7,9752%	5,8050%	1,2083	24,2435%	1,70%	106.234.787,29	63
2	DAHLIA ACOES FC FIA	4,5139%	2,1825%	1,0367	19,8097%	1,85%	148.651.573,56	63
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	3,8561%	1,5139%	1,0223	19,2670%	2,00%	399.110.941,03	63
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	3,7068%	1,3674%	1,0246	19,3260%	2,00%	296.560.548,68	63
5	MULTIPREV FIA	2,7749%	0,4125%	0,9977	18,4897%	0,00%	675.278.850,13	63
6	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	2,5245%	0,1780%	1,0122	18,7736%	0,00%	181.276.860,45	63
7	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	2,4925%	0,1362%	1,0004	18,5686%	0,00%	1.075.027.083,52	63
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	2,4519%	0,0900%	0,9937	18,4519%	0,15%	158.713.966,86	63
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	2,4426%	0,0863%	1,0005	18,5699%	0,15%	178.143.013,74	63
10	SANTANDER FI IBRX ACOES	2,4033%	0,0445%	0,9976	18,5153%	0,10%	511.196.054,39	63
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	2,4013%	0,0450%	1,0004	18,5688%	0,30%	51.939.827,71	63
12	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	2,3613%	0,0022%	0,9976	18,5103%	0,19%	26.899.982,29	63
13	COMSHELL CONCHA FIA	2,3323%	-0,0324%	0,9929	18,3968%	0,17%	64.919.092,34	63
14	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	2,2139%	-0,1855%	0,9509	17,6729%	0,30%	34.085.654,62	63
15	IAJA ACOES FC FIA	2,1760%	-0,2097%	0,9700	18,0626%	0,08%	211.038.949,15	63
16	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	2,1294%	-0,2264%	1,0032	18,5870%	0,56%	64.778.540,12	63
17	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	2,0919%	-0,2375%	1,0271	19,1532%	0,70%	30.012.260,11	63
18	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	2,0478%	-0,3302%	0,9766	18,1217%	0,00%	214.015.226,80	63
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	2,0276%	-0,3527%	0,9745	18,0785%	0,00%	62.711.956,20	63
20	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	1,8337%	-0,5619%	0,9559	17,8085%	0,35%	8.468.358,90	63
21	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	1,7999%	-0,6047%	0,9478	17,5759%	0,75%	31.124.293,29	63
22	CITIPREVI INST FI EM ACOES	1,6800%	-0,7089%	0,9616	17,9321%	0,15%	73.373.548,02	63
23	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	1,4269%	-0,9381%	0,9909	18,3977%	0,00%	357.238.725,15	63
24	BRAM FIA IBRX ATIVO	1,4260%	-0,9417%	0,9881	18,3410%	0,00%	356.524.844,53	63
25	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	1,3522%	-1,0133%	0,9917	18,3902%	0,00%	129.045.108,29	63
26	BRADESCO FIA SALUBRE	1,2511%	-1,1225%	0,9822	18,2205%	0,50%	128.877.762,62	63
27	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	1,2080%	-1,1594%	0,9888	18,3484%	0,70%	12.117.012,76	63
28	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	1,1921%	-1,2255%	0,9413	17,6599%	0,41%	349.468.011,83	63
29	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1,1802%	-1,1873%	0,9884	18,3467%	0,90%	178.649.071,47	63
30	BB ECO GOLD FI EM ACOES	1,1798%	-1,1818%	0,9956	18,4771%	0,09%	376.747.718,58	63
31	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	1,1628%	-1,1994%	0,9948	18,4630%	0,01%	377.066.546,85	63
32	IAJA SAM ACOES FI	0,9885%	-1,3739%	0,9949	18,5002%	0,22%	132.449.244,41	63
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,2572%	-2,1801%	0,9188	17,3015%	0,75%	83.627.143,01	63
	MÉDIA:	2,2079%	-0,1548%	0,9948	18,5736%		214.708.259,35	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/05/2023 A 31/05/2023
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	RPS FIC FI ACOES SELECTION	9,6457%	5,8760%	1,0749	19,1808%	1,70%	106.234.787,29	22
2	DAHLIA ACOES FC FIA	5,0236%	1,2359%	1,0890	19,3552%	1,85%	148.651.573,56	22
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	4,9309%	1,3671%	0,9827	17,2303%	2,00%	399.110.941,03	22
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	4,7739%	1,1985%	0,9869	17,3217%	2,00%	296.560.548,68	22
5	IAJA ACOES FC FIA	3,9289%	0,4483%	0,9536	16,4359%	0,08%	211.038.949,15	22
6	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	3,6129%	0,0200%	0,9997	17,1612%	0,00%	1.075.027.083,52	22
7	MULTIPREV FIA	3,6099%	0,0813%	0,9757	16,7278%	0,00%	675.278.850,13	22
8	SANTANDER FI IBRX ACOES	3,6062%	0,0240%	0,9957	17,0878%	0,10%	511.196.054,39	22
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	3,5952%	0,0025%	0,9996	17,1597%	0,15%	178.143.013,74	22
10	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	3,5897%	-0,0456%	1,0187	17,4634%	0,00%	181.276.860,45	22
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	3,5780%	-0,0146%	0,9996	17,1595%	0,30%	51.939.827,71	22
12	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	3,5763%	0,0041%	0,9912	17,0184%	0,15%	158.713.966,86	22
13	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	3,5421%	-0,0441%	0,9975	17,1148%	0,19%	26.899.982,29	22
14	IAJA SAM ACOES FI	3,5188%	-0,0349%	0,9839	16,9305%	0,22%	132.449.244,41	22
15	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	3,5133%	-0,2010%	1,0474	18,0326%	0,70%	30.012.260,11	22
16	COMSHELL CONCHA FIA	3,4780%	-0,1049%	0,9986	17,1022%	0,17%	64.919.092,34	22
17	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	3,4562%	-0,1731%	1,0154	17,4255%	0,56%	64.778.540,12	22
18	BRAM FIA IBRX ATIVO	3,4525%	-0,0884%	0,9792	16,8042%	0,00%	356.524.844,53	22
19	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	3,4502%	-0,0941%	0,9804	16,8292%	0,00%	357.238.725,15	22
20	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	3,4194%	-0,0441%	0,9476	16,2633%	0,30%	34.085.654,62	22
21	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	3,4040%	-0,1500%	0,9843	16,8973%	0,00%	129.045.108,29	22
22	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	3,4019%	-0,1206%	0,9733	16,6850%	0,35%	8.468.358,90	22
23	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	3,3977%	-0,1306%	0,9749	16,7173%	0,00%	214.015.226,80	22
24	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	3,3646%	-0,1768%	0,9794	16,8078%	0,90%	178.649.071,47	22
25	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	3,3357%	-0,1894%	0,9743	16,6983%	0,00%	62.711.956,20	22
26	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	3,3191%	-0,2275%	0,9813	16,8455%	0,70%	12.117.012,76	22
27	BB ECO GOLD FI EM ACOES	3,3102%	-0,2920%	1,0033	17,2438%	0,09%	376.747.718,58	22
28	BRADESCO FIA SALUBRE	3,3047%	-0,2030%	0,9659	16,5750%	0,50%	128.877.762,62	22
29	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	3,3028%	-0,2975%	1,0026	17,2304%	0,01%	377.066.546,85	22
30	CITIPREVI INST FI EM ACOES	3,2304%	-0,2683%	0,9612	16,5601%	0,15%	73.373.548,02	22
31	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	3,1850%	-0,2678%	0,9450	16,1954%	0,75%	31.124.293,29	22
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	2,9873%	-0,4179%	0,9353	16,1812%	0,41%	349.468.011,83	22
33	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	2,6352%	-0,6656%	0,8911	15,3811%	0,75%	83.627.143,01	22
	MÉDIA:	3,7418%	0,1820%	0,9876	17,0249%		214.708.259,35	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: -.-
MULTIMERCADOS*

Maio/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: 1,84157
 PATRIMÔNIO: 13.699.926,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	90,81%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,48%	SMLL	1,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	3,24%
IMA B 5	3,48%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,99%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 28,26%

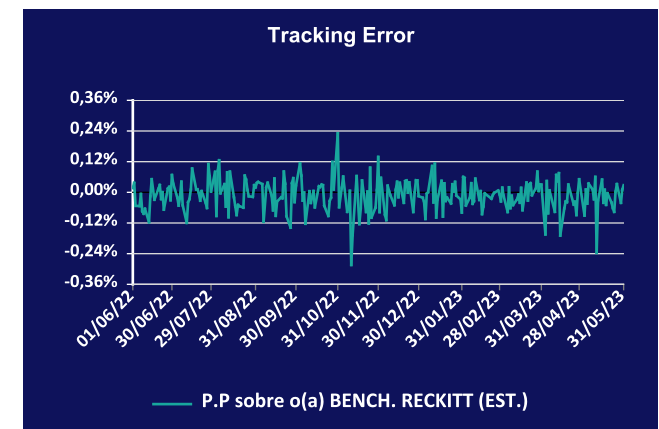
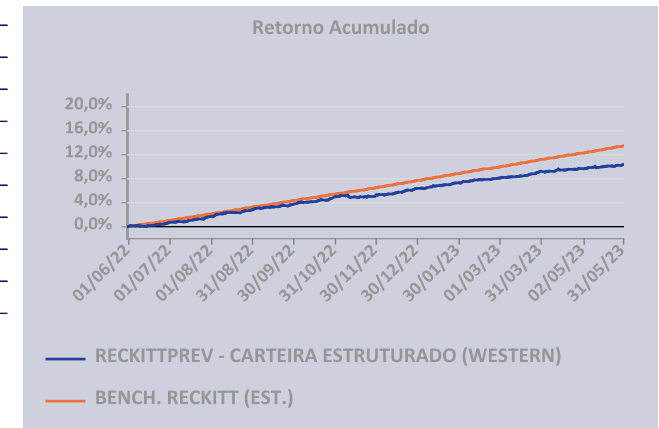
SELEÇÃO: 71,74%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0110%	--
RETORNO ACUMULADO	10,3826%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,4809%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,0982%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0191	--
SHARPE	-0,1760	--
SORTINO	-0,2125	--
STERLING RATIO	-0,1921	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,9345	--
DOWNSIDE RISK	0,0518%	--
RISCO ATIVO	0,0625%	--
RISCO TOTAL	0,0625%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,9933%	--

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)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,62%	3,77%	10,38%	14,39%	19,63%	0,28% (31/10/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	2,78% (10/11/2022)	-3,82% (03/10/2022)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,84157
 PATRIMÔNIO: 13.699.926,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,17%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,73%	SMLL	0,00%
IDIV	0,84%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,25%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 8,29%

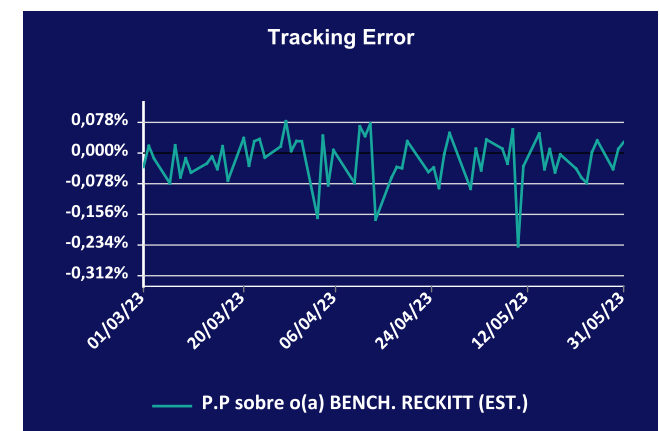
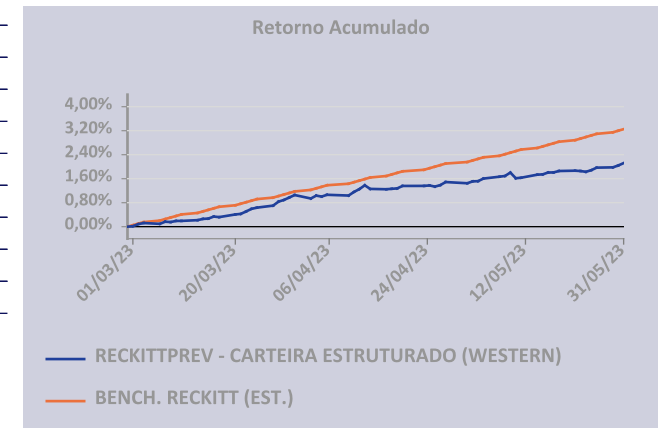
SELEÇÃO: 91,71%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0174%	--
RETORNO ACUMULADO	2,1199%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2505%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,1305%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0642	--
SHARPE	-0,2965	--
SORTINO	-0,3148	--
STERLING RATIO	-0,2882	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,0522	--
DOWNSIDE RISK	0,0554%	--
RISCO ATIVO	0,0588%	--
RISCO TOTAL	0,0588%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,9349%	--

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	0,62%	3,77%	10,38%	14,39%	19,63%	0,13% (28/03/2023)	-0,19% (11/05/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	4,29% (11/04/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	4,29% (11/04/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	4,40% (11/04/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	3,20% (11/04/2023)	-2,04% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,26% (13/03/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,28% (09/03/2023)	-0,16% (19/04/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)

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: 1,84157
 PATRIMÔNIO: 13.699.926,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	97,66%	IBOVESPA	0,60%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,76%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,97%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 7,78%

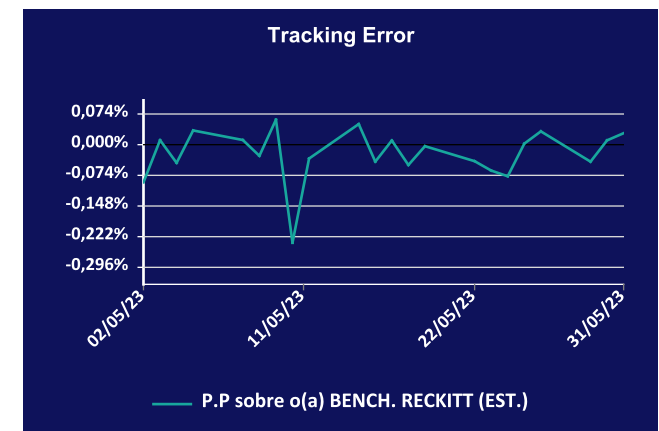
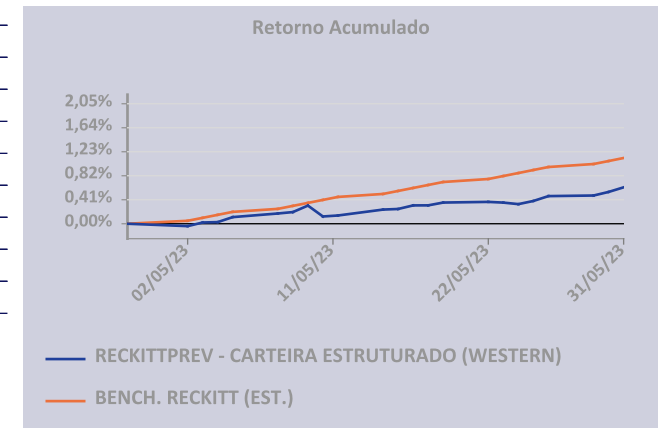
SELEÇÃO: 92,22%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0225%	--
RETORNO ACUMULADO	0,6228%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1233%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5004%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,1160	--
SHARPE	-0,3576	--
SORTINO	-0,3624	--
STERLING RATIO	-0,2564	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,4467	--
DOWNSIDE RISK	0,0621%	--
RISCO ATIVO	0,0630%	--
RISCO TOTAL	0,0630%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,0006%	--

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	0,6228%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,6228%(05/2023)



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	0,62%	3,77%	10,38%	14,39%	19,63%	0,11% (10/05/2023)	-0,19% (11/05/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	2,91% (05/05/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	2,92% (05/05/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	2,19% (05/05/2023)	-1,46% (02/05/2023)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	3,51% (05/05/2023)	-2,20% (16/05/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	2,41% (05/05/2023)	-2,04% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,26% (11/05/2023)	-0,07% (09/05/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,19% (04/05/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,76% (12/05/2023)	-0,37% (16/05/2023)
IMA-GERAL	1,77%	6,78%	12,55%	18,47%	23,45%	0,21% (04/05/2023)	-0,08% (16/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,28% (30/05/2023)	-0,93% (12/05/2023)



*Agrupamento: -.-
INVEST. NO EXTERIOR*

Maio/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: 2,80657
 PATRIMÔNIO: 9.468.904,69

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	68,98%
DÓLAR PTAX	31,02%		

ESTILO: 60,09%

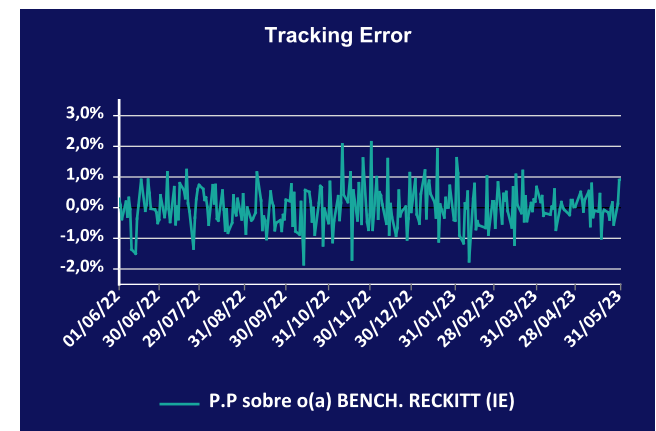
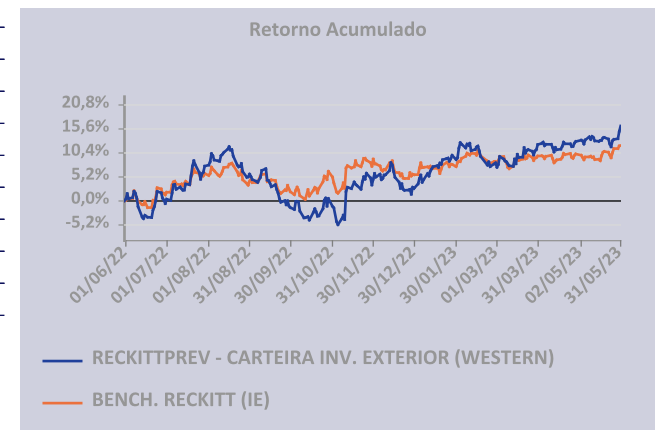
SELEÇÃO: 39,91%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0146%	--
RETORNO ACUMULADO	16,2430%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	12,0128%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	4,2302%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0009	--
SHARPE	0,0144	--
SORTINO	0,0220	--
STERLING RATIO	0,0091	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,6629	--
DOWNSIDE RISK	0,6669%	--
RISCO ATIVO	0,6486%	--
RISCO TOTAL	1,0150%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	16,1128%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	7
MESES NEGATIVOS	5
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	7
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	5
MAIOR RETORNO MENSAL	8,1428%(07/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-6,8297%(09/2022)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	2,98%	13,16%	16,24%	-5,81%	12,65%	6,32% (10/11/2022)	-3,00% (03/11/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	1,66%	5,99%	12,01%	10,39%	29,53%	4,26% (10/11/2022)	-1,91% (26/08/2022)
MSCI EUROPE	-6,52%	6,44%	1,92%	-10,40%	24,82%	4,58% (04/10/2022)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	-1,25%	7,60%	0,34%	-5,89%	30,39%	5,05% (10/11/2022)	-3,66% (13/09/2022)
DÓLAR D2	1,83%	-3,91%	6,95%	-2,72%	-5,54%	3,73% (10/11/2022)	-3,87% (03/10/2022)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	2,78% (10/11/2022)	-3,82% (03/10/2022)
EURO PTAX	-1,67%	-2,53%	6,96%	-15,18%	-9,95%	4,34% (10/11/2022)	-3,57% (03/10/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,63%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%	7,97% (10/11/2022)	-3,37% (03/11/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	0,56%	3,40%	7,31%	-8,44%	23,16%	8,97% (10/11/2022)	-3,74% (26/08/2022)
S&P 500	0,25%	8,86%	1,15%	-0,58%	37,30%	5,54% (10/11/2022)	-4,32% (13/09/2022)
S&P 500 BRL PTAX	2,16%	6,32%	9,00%	-3,09%	28,94%	8,48% (10/11/2022)	-3,88% (26/08/2022)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,80657
 PATRIMÔNIO: 9.468.904,69

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	31,66%	MSCI WORLD	32,23%
DÓLAR PTAX	36,12%		

ESTILO: 55,64%

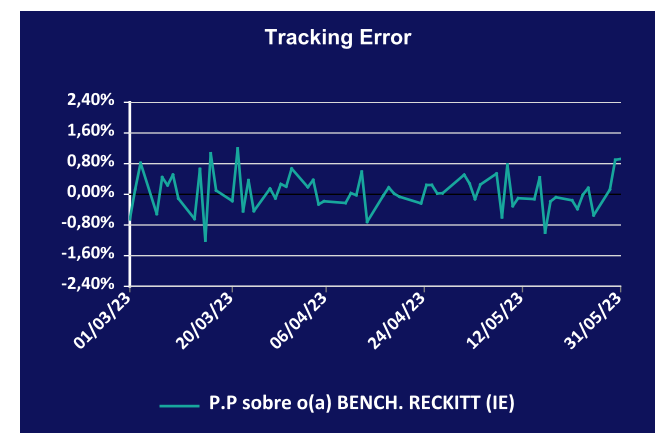
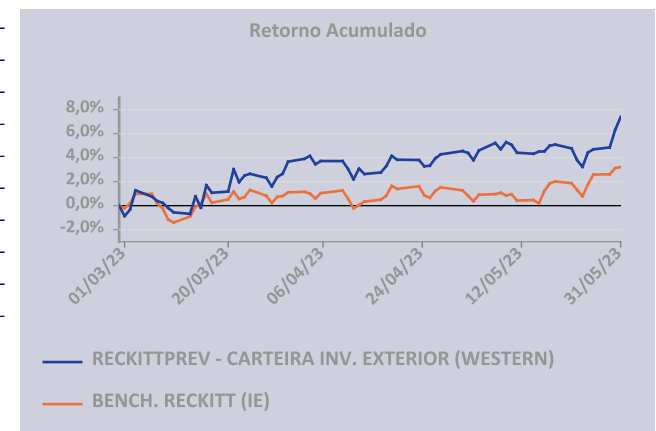
SELEÇÃO: 44,36%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0647%	--
RETORNO ACUMULADO	7,3859%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2144%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	4,1715%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0156	--
SHARPE	0,0926	--
SORTINO	0,1600	--
STERLING RATIO	0,0639	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,0628	--
DOWNSIDE RISK	0,4048%	--
RISCO ATIVO	0,4798%	--
RISCO TOTAL	0,6993%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	11,1013%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	3,6648%(03/2023)
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	2,98%	13,16%	16,24%	-5,81%	12,65%	1,89% (16/03/2023)	-1,05% (22/03/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	1,66%	5,99%	12,01%	10,39%	29,53%	1,02% (17/05/2023)	-0,93% (09/03/2023)
MSCI EUROPE	-6,52%	6,44%	1,92%	-10,40%	24,82%	2,02% (16/03/2023)	-4,59% (15/03/2023)
MSCI WORLD	-1,25%	7,60%	0,34%	-5,89%	30,39%	1,54% (05/05/2023)	-1,44% (07/03/2023)
DÓLAR D2	1,83%	-3,91%	6,95%	-2,72%	-5,54%	1,74% (19/04/2023)	-1,69% (27/04/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)
EURO PTAX	-1,67%	-2,53%	6,96%	-15,18%	-9,95%	2,04% (10/03/2023)	-1,48% (12/05/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,63%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%	1,50% (19/04/2023)	-1,57% (07/03/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	0,56%	3,40%	7,31%	-8,44%	23,16%	1,92% (25/05/2023)	-1,49% (24/05/2023)
S&P 500	0,25%	8,86%	1,15%	-0,58%	37,30%	1,96% (27/04/2023)	-1,85% (09/03/2023)
S&P 500 BRL PTAX	2,16%	6,32%	9,00%	-3,09%	28,94%	1,99% (17/05/2023)	-1,91% (09/03/2023)

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: 2,80657
 PATRIMÔNIO: 9.468.904,69

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	31,54%	MSCI WORLD	12,12%
DÓLAR PTAX	56,34%		

ESTILO: 57,45%

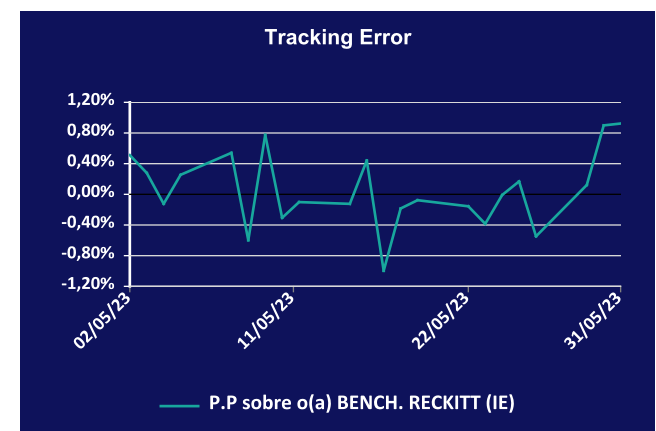
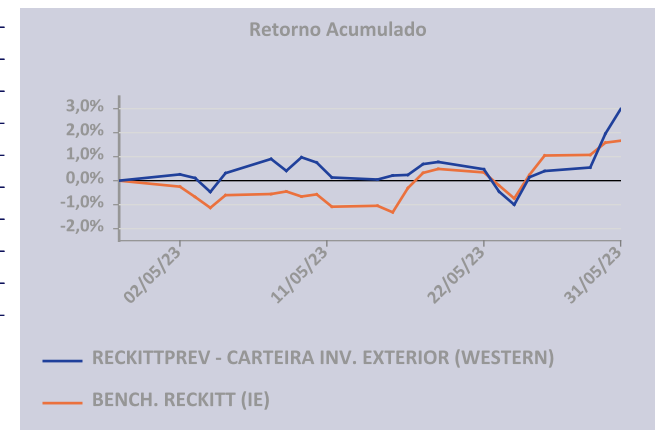
SELEÇÃO: 42,55%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0846%	--
RETORNO ACUMULADO	2,9821%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,6640%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,3180%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0386	--
SHARPE	0,1382	--
SORTINO	0,2413	--
STERLING RATIO	0,0860	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,3511	--
DOWNSIDE RISK	0,3507%	--
RISCO ATIVO	0,4935%	--
RISCO TOTAL	0,6122%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	9,7194%	--

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	2,9821%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	2,9821%(05/2023)



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	2,98%	13,16%	16,24%	-5,81%	12,65%	1,40% (30/05/2023)	-0,93% (23/05/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	1,66%	5,99%	12,01%	10,39%	29,53%	1,02% (17/05/2023)	-0,54% (23/05/2023)
MSCI EUROPE	-6,52%	6,44%	1,92%	-10,40%	24,82%	1,10% (05/05/2023)	-1,92% (24/05/2023)
MSCI WORLD	-1,25%	7,60%	0,34%	-5,89%	30,39%	1,54% (05/05/2023)	-1,08% (02/05/2023)
DÓLAR D2	1,83%	-3,91%	6,95%	-2,72%	-5,54%	1,63% (25/05/2023)	-1,17% (05/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,28% (30/05/2023)	-0,93% (12/05/2023)
EURO PTAX	-1,67%	-2,53%	6,96%	-15,18%	-9,95%	1,36% (30/05/2023)	-1,48% (12/05/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	0,63%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%	1,46% (17/05/2023)	-1,39% (24/05/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	0,56%	3,40%	7,31%	-8,44%	23,16%	1,92% (25/05/2023)	-1,49% (24/05/2023)
S&P 500	0,25%	8,86%	1,15%	-0,58%	37,30%	1,85% (05/05/2023)	-1,20% (02/05/2023)
S&P 500 BRL PTAX	2,16%	6,32%	9,00%	-3,09%	28,94%	1,99% (17/05/2023)	-1,13% (23/05/2023)

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)*

Maio/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: 2,49401
 PATRIMÔNIO: 144.202.222,18

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	90,50%	IBX	5,38%
	IVBX-2	0,20%	SMLL	2,78%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA B 5	0,26%	IMA B 5+	0,00%
	IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,88%

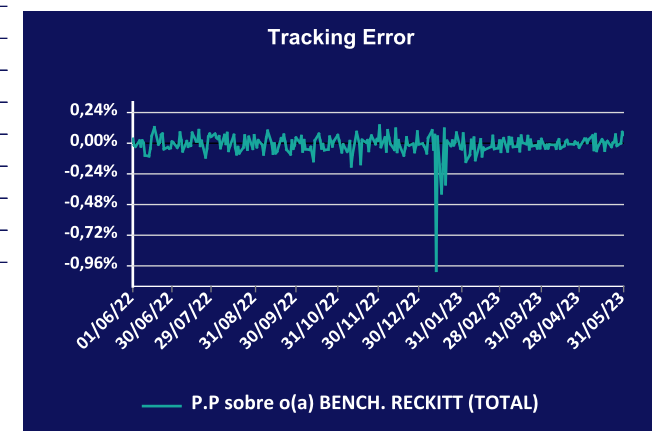
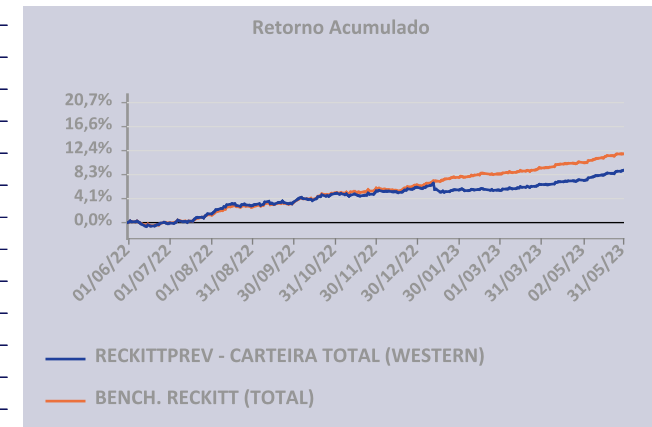
ESTILO: 58,35% | SELEÇÃO: 41,65%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0157%	--
RETORNO ACUMULADO	9,0464%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,8628%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,8164%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0087%	--
BETA	0,0835	--
MARKET TIMING	-0,1146	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5539	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	75,7623%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	40,8592%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,8220	--
JENSEN	-2,9374%	--
MODIGLIANI	-21,6205%	--
SHARPE	-0,1048	--
SORTINO	-0,1280	--
TREYNOR	-0,0018	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	65,1522	--
DOWNSIDE RISK	0,1232%	--
RISCO ATIVO	0,0881%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,4001%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1004%	--
RISCO TOTAL	0,1504%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,3881%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	9
MESES NEGATIVOS	3
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	4
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	8
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	1,55%	2,79%	9,05%	9,36%	21,36%	0,48% (03/10/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,27%	5,04%	11,86%	17,14%	30,12%	0,48% (03/10/2022)	-0,30% (17/06/2022)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/06/2022)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	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: 2,49401
 PATRIMÔNIO: 144.202.222,18

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	91,86%	IBX	5,30%
	IVBX-2	0,00%	SMML	0,69%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
	IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	2,15%

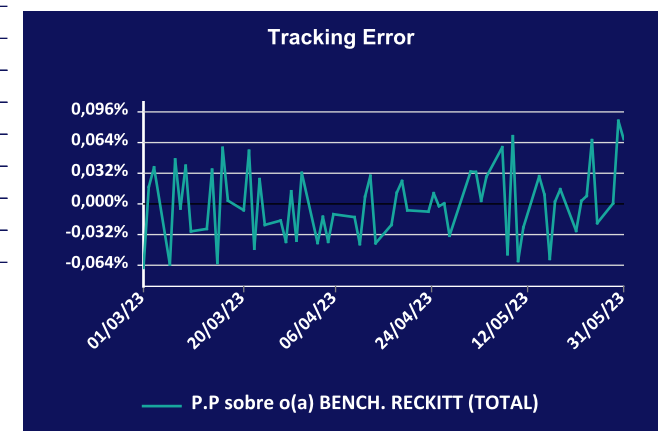
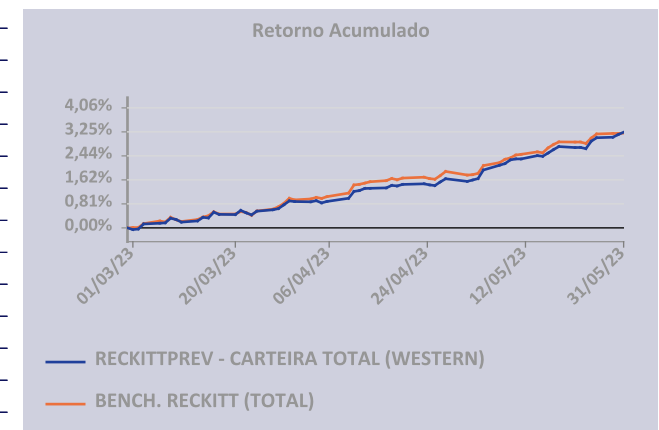
ESTILO: 65,17% | SELEÇÃO: 34,83%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0001%	--
RETORNO ACUMULADO	3,2381%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2060%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0320%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0018%	--
BETA	0,0573	--
MARKET TIMING	-0,1208	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,6232	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	19,7339%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	35,0914%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,2111	--
JENSEN	0,0380%	--
MODIGLIANI	0,7209%	--
SHARPE	-0,0018	--
SORTINO	-0,0028	--
TREYNOR	-0,0000	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,2764	--
DOWNSIDE RISK	0,0546%	--
RISCO ATIVO	0,0372%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,5917%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0514%	--
RISCO TOTAL	0,0836%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3286%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,5503%(05/2023)
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	1,55%	2,79%	9,05%	9,36%	21,36%	0,29% (05/05/2023)	-0,09% (10/03/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,27%	5,04%	11,86%	17,14%	30,12%	0,27% (11/04/2023)	-0,12% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (14/04/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	4,29% (11/04/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	4,29% (11/04/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	4,40% (11/04/2023)	-2,20% (23/03/2023)
SMML	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	4,63% (11/04/2023)	-3,43% (23/03/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	3,20% (11/04/2023)	-2,04% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,40% (11/04/2023)	-0,27% (19/04/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,26% (13/03/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,81% (13/04/2023)	-0,60% (19/04/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,59% (19/04/2023)	-1,39% (11/04/2023)

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: 2,49401
 PATRIMÔNIO: 144.202.222,18

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	68,67%	IBX	4,34%
IVBX-2	0,00%	SMLL	2,40%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	20,30%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,17%	DÓLAR PTAX	4,12%

ESTILO: 76,69%

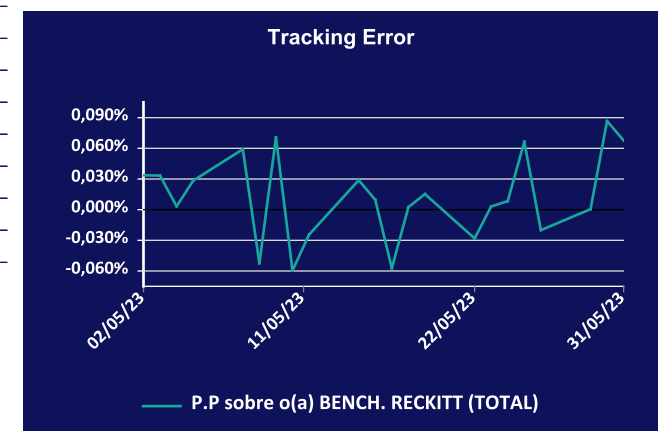
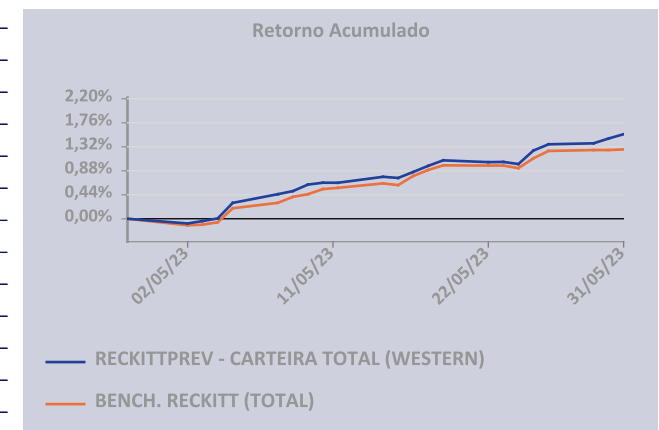
SELEÇÃO: 23,31%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0192%	--
RETORNO ACUMULADO	1,5503%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,2710%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,2792%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0047%	--
BETA	0,0643	--
MARKET TIMING	0,6218	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,6686	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	27,8399%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9988%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	70,2149%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	4,7240	--
JENSEN	0,2641%	--
MODIGLIANI	2,7473%	--
SHARPE	0,2169	--
SORTINO	0,4244	--
TREYNOR	0,0029	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,0105	--
DOWNSIDE RISK	0,0452%	--
RISCO ATIVO	0,0420%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,6681%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0524%	--
RISCO TOTAL	0,0884%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4048%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	1,5503%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,5503%(05/2023)



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	1,55%	2,79%	9,05%	9,36%	21,36%	0,29% (05/05/2023)	-0,09% (02/05/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,27%	5,04%	11,86%	17,14%	30,12%	0,26% (05/05/2023)	-0,12% (02/05/2023)
CDI	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (04/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
IBOVESPA	3,74%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%	2,91% (05/05/2023)	-2,40% (02/05/2023)
IBX	3,59%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%	2,92% (05/05/2023)	-2,42% (02/05/2023)
IVBX-2	7,52%	-0,08%	-8,77%	-28,89%	-3,56%	2,19% (05/05/2023)	-1,46% (02/05/2023)
SMLL	13,54%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%	3,51% (05/05/2023)	-2,20% (16/05/2023)
IDIV	0,84%	0,48%	-0,85%	1,55%	39,98%	2,41% (05/05/2023)	-2,04% (02/05/2023)
IRF-M	2,20%	7,34%	14,73%	16,57%	17,40%	0,26% (11/05/2023)	-0,07% (09/05/2023)
IMA B 5	0,57%	5,93%	9,45%	19,90%	28,76%	0,19% (04/05/2023)	-0,17% (17/05/2023)
IMA B 5+	4,13%	11,16%	11,30%	11,03%	22,89%	0,76% (12/05/2023)	-0,37% (16/05/2023)
DÓLAR PTAX	1,90%	-2,33%	7,76%	-2,61%	-6,09%	1,28% (30/05/2023)	-0,93% (12/05/2023)