

**pps** *portfolio  
performance*

*Avaliação de Performance: RECKITT PREV*  
*Plano de Gestão Administrativa*

*Maio/2023*

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

---

A Reckitt PreV efetuou a segregação dos Planos sob a sua tutela, seguindo o disposto na Resolução PREVIC nº 12, de 16 de agosto de 2022. Dessa forma, os recursos do Plano de Gestão Administrativa, respeitando o descrito em sua Política de Investimentos, foram alocados no segmento de renda fixa, em um único fundo condominial, abaixo indicado, de estratégia associada à taxa SELIC.

### **RENDA FIXA**

- **ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES FIC FI**: Este fundo conta com alocação preponderante em títulos públicos pós-fixados. É vedada a exposição em títulos privados emitidos por instituições financeiras e não-financeiras. O primeiro aporte ocorreu no início de mai/23. Sendo assim, limitamo-nos a comentar que a sua evolução se mostrou aderente às características de um mandato bastante conservador e que o rendimento, no mês em análise, foi equivalente a 101,5% da taxa SELIC, líquidos de taxa de administração.



*Agrupamento: Renda Fixa  
CONSERVADOR*

*Maio/2023*

**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: 06.175.696/0001-73  
 Cód. ANBIMA: 133906  
 NOME FANTASIA: ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC  
 GESTOR: ITAU UNIBANCO SA  
 ADMINISTRADOR: ITAU UNIBANCO SA  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,15%  
 BENCHMARK: SELIC

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 60,27153  
 PATRIMÔNIO: 40.509.656.994,14

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: RENDA FIXA - CONSERVADOR  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: SELIC

**ANÁLISE DE ESTILO**

CDI	99,69%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,26%
IMA-C	0,05%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 16,81%

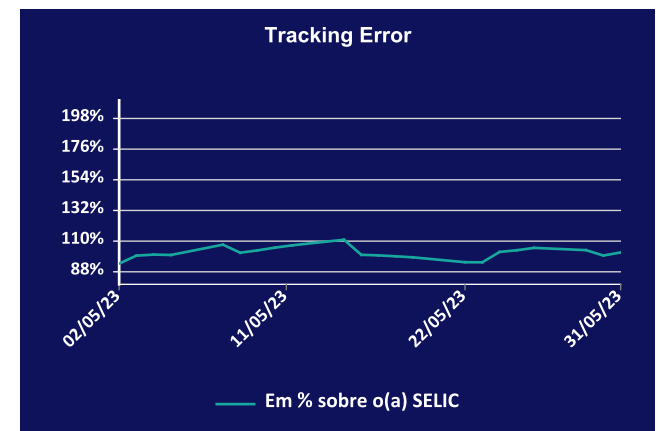
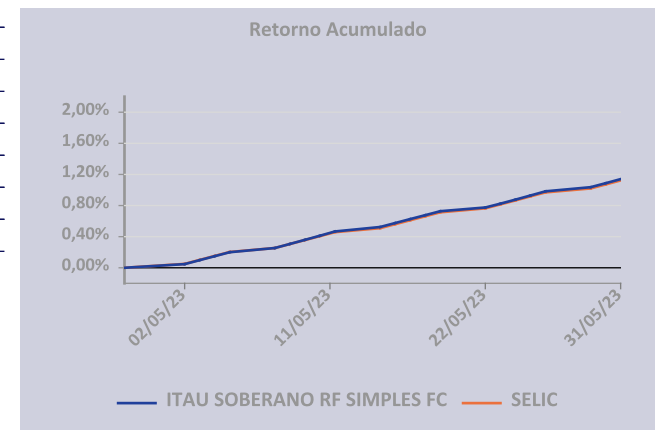
SELEÇÃO: 83,19%

**DESEMPENHO**

<b>RETORNO</b>		
PRÊMIO MÉDIO	0,0007%	12° de 41
RETORNO ACUMULADO	1,1400%	12° de 41
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1233%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	101,4919%	--
<b>ÍNDICES RETORNO/RISCO</b>		
SHARPE	0,3521	14° de 41
SORTINO	0,7161	14° de 41
<b>RISCO</b>		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,6251	--
DOWNSIDE RISK	0,0010%	14° de 41
RISCO ATIVO	4,2140%	8° de 41
RISCO TOTAL	0,0021%	8° de 41
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,0339%	8° de 41

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO SELIC	1
MESES ABAIXO DO SELIC	0
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1401%(05/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	1,1401%(05/2023)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com: SELIC

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,14%	5,34%	13,41%	22,44%	24,71%	0,06% (15/05/2023)	0,05% (02/05/2023)
SELIC	1,12%	5,37%	13,48%	22,48%	25,15%	0,05% (19/05/2023)	0,05% (22/05/2023)
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)

SHARPE

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 SHARPE  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 50.000.000

RANKING	FUNDO	SHARPE	RETORNO	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	BRAM FI RF TARGET	1,1736	1,1753%	0,0023%	0,0316%	0,00%	808.402.639,23	22
2	BRAM FI RF REF DI FEDERAL III	0,7829	1,1488%	0,0011%	0,0233%	0,00%	3.743.083.038,34	22
3	BB TOP PRINCIPAL RENDA FIXA REF DI LP FI	0,7038	1,1500%	0,0012%	0,0270%	0,00%	13.739.466.922,52	22
4	ITAU VERSO A RF REFERENCIADO DI FI	0,6328	1,1534%	0,0014%	0,0340%	0,00%	50.262.879.957,70	22
5	SANTANDER RF REF DI TITULOS PUBLICOS FI	0,6038	1,1528%	0,0013%	0,0348%	0,00%	14.703.360.923,85	22
6	BRADESCO FI RF VEGA	0,5887	1,1341%	0,0005%	0,0130%	0,00%	325.419.010,59	22
7	BRAM FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL II	0,5754	1,1427%	0,0009%	0,0240%	0,00%	2.853.587.464,59	22
8	BRADESCO FI RF MATRIZ	0,4998	1,1375%	0,0006%	0,0203%	0,00%	510.379.896,64	22
9	BEM FI RENDA FIXA SIMPLES TPF	0,4719	1,1405%	0,0008%	0,0260%	0,00%	12.495.219.944,68	22
10	BRADESCO FI RF REF DI LONGO PRAZO CIP	0,4603	1,1292%	0,0003%	0,0091%	0,08%	729.212.898,54	22
11	SICREDI TAXA SELIC FIC FI RF LP	0,4543	1,1568%	0,0015%	0,0526%	0,40%	1.118.462.455,55	22
12	WA SOVEREIGN IV SELIC RF REFERENCIADO FI	0,4148	1,1672%	0,0020%	0,0755%	0,00%	4.009.585.101,03	22
13	WA SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,3916	1,1459%	0,0010%	0,0412%	0,15%	599.435.794,01	22
14	ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	0,3521	1,1401%	0,0008%	0,0340%	0,15%	40.509.656.994,14	22
15	PLURAL YIELD FIRF REFERENCIADO DI	0,3094	1,1279%	0,0002%	0,0106%	0,25%	229.159.851,44	22
16	BRADESCO FI RENDA FIXA CARDIAL	0,2653	1,1266%	0,0001%	0,0088%	0,00%	202.041.884,82	22
17	BB TOP RENDA FIXA SIMPLES FI	0,2594	1,1332%	0,0004%	0,0273%	0,00%	92.191.286.556,04	22
18	BRAM FI RF REFERENCIADO DI RUBI	0,2559	1,1449%	0,0010%	0,0604%	0,00%	14.022.639.622,56	22
19	SICREDI FI MAPFRE RF	0,1862	1,1338%	0,0005%	0,0400%	0,50%	347.407.290,08	22
20	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REF DI	0,1086	1,1320%	0,0004%	0,0573%	0,20%	13.081.140.366,94	22
21	BAHIA AM FI RF REFERENCIADO DI	0,0416	1,1245%	0,0001%	0,0197%	0,25%	172.923.590,76	22
22	SANT FI BAIXO RISCO LIQUIDEZ RF REF DI	0,0029	1,1234%	0,0000%	0,0103%	0,10%	615.505.838,64	22
23	BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC FI RF LP	-0,0124	1,1230%	-0,0000%	0,0155%	0,20%	922.093.011,10	22
24	BRADESCO H FI RF REF DI LP	-0,0298	1,1224%	-0,0000%	0,0210%	0,15%	520.468.980,03	22
25	SAF SOBERANO REG PP II FC FI RF REF DI	-0,0363	1,1229%	-0,0000%	0,0077%	0,06%	6.069.341.716,27	22
26	BRAD H FI RF REF DI LP TITULOS PUBLICOS	-0,1650	1,1184%	-0,0002%	0,0211%	0,25%	713.359.043,18	22
27	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	-0,2699	1,1118%	-0,0005%	0,0305%	0,15%	10.734.055.017,35	22
28	FI RENDA FIXA PETROS LIQUIDEZ	-0,8469	1,1219%	-0,0001%	0,0012%	0,00%	5.155.879.925,28	22
29	SAFRA SOB REG PROPRIO FC FI RF REF DI	-0,9010	1,1135%	-0,0004%	0,0077%	0,15%	5.158.691.701,67	22
30	BNPP SOBERANO FC DE FI RF SIMPLES	-0,9226	1,1082%	-0,0007%	0,0117%	0,22%	625.345.290,64	22
31	ENERGY RF FI	-0,9624	1,1208%	-0,0001%	0,0018%	0,00%	3.120.545.095,43	22
32	BRADESCO FI RF REF DI PERFORMANCE	-1,0762	1,0852%	-0,0017%	0,0253%	0,10%	134.950.678,27	22
33	BB PREVIDENCIARIO FLUXO RF SIMPLES FC FI	-2,0888	1,0442%	-0,0036%	0,0270%	1,00%	3.860.323.166,27	22
34	CREDIT SUISSE CASH FI MULT CRED PRIVADO	-2,0924	1,1111%	-0,0005%	0,0042%	0,10%	334.677.222,35	22

SHARPE

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 SHARPE  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 50.000.000

RANKING	FUNDO	SHARPE	RETORNO	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35	BRADESCO FI RF REF DI ESTRELA	-2,4558	1,0756%	-0,0021%	0,0139%	1,00%	409.749.140,45	22
36	BRADESCO FI RF EMPRESA	-2,9381	1,0507%	-0,0033%	0,0176%	0,10%	59.916.685,43	22
37	PARDO RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO	-4,6462	1,1110%	-0,0006%	0,0019%	0,10%	355.888.517,67	22
38	SANTANDER RF CURTO PRAZO FI	-4,8200	1,1204%	-0,0001%	0,0004%	0,00%	1.143.120.269,55	22
39	CAIXA FIC BRASIL DISPONIBILIDADES RF	-6,2752	0,9700%	-0,0069%	0,0175%	0,80%	900.415.296,74	22
40	CAIXA FI ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF CP	-13,0374	1,1023%	-0,0009%	0,0012%	0,20%	2.732.465.875,67	22
41	SANTANDER CASH RED FI RF REF DI	-45,6329	1,0862%	-0,0017%	0,0006%	0,40%	820.182.332,68	22
	MÉDIA:	-1,9433	1,1205%	-0,0001%	0,0222%		7.586.383.585,58	

## 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: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 50.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	BRAM FI RF TARGET	1,1753%	1,1736	0,0023%	0,0316%	0,00%	808.402.639,23	22
2	WA SOVEREIGN IV SELIC RF REFERENCIADO FI	1,1672%	0,4148	0,0020%	0,0755%	0,00%	4.009.585.101,03	22
3	SICREDI TAXA SELIC FIC FI RF LP	1,1568%	0,4543	0,0015%	0,0526%	0,40%	1.118.462.455,55	22
4	ITAU VERSO A RF REFERENCIADO DI FI	1,1534%	0,6328	0,0014%	0,0340%	0,00%	50.262.879.957,70	22
5	SANTANDER RF REF DI TITULOS PUBLICOS FI	1,1528%	0,6038	0,0013%	0,0348%	0,00%	14.703.360.923,85	22
6	BB TOP PRINCIPAL RENDA FIXA REF DI LP FI	1,1500%	0,7038	0,0012%	0,0270%	0,00%	13.739.466.922,52	22
7	BRAM FI RF REF DI FEDERAL III	1,1488%	0,7829	0,0011%	0,0233%	0,00%	3.743.083.038,34	22
8	WA SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	1,1459%	0,3916	0,0010%	0,0412%	0,15%	599.435.794,01	22
9	BRAM FI RF REFERENCIADO DI RUBI	1,1449%	0,2559	0,0010%	0,0604%	0,00%	14.022.639.622,56	22
10	BRAM FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL II	1,1427%	0,5754	0,0009%	0,0240%	0,00%	2.853.587.464,59	22
11	BEM FI RENDA FIXA SIMPLES TPF	1,1405%	0,4719	0,0008%	0,0260%	0,00%	12.495.219.944,68	22
12	ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	1,1401%	0,3521	0,0008%	0,0340%	0,15%	40.509.656.994,14	22
13	BRADESCO FI RF MATRIZ	1,1375%	0,4998	0,0006%	0,0203%	0,00%	510.379.896,64	22
14	BRADESCO FI RF VEGA	1,1341%	0,5887	0,0005%	0,0130%	0,00%	325.419.010,59	22
15	SICREDI FI MAPFRE RF	1,1338%	0,1862	0,0005%	0,0400%	0,50%	347.407.290,08	22
16	BB TOP RENDA FIXA SIMPLES FI	1,1332%	0,2594	0,0004%	0,0273%	0,00%	92.191.286.556,04	22
17	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REF DI	1,1320%	0,1086	0,0004%	0,0573%	0,20%	13.081.140.366,94	22
18	BRADESCO FI RF REF DI LONGO PRAZO CIP	1,1292%	0,4603	0,0003%	0,0091%	0,08%	729.212.898,54	22
19	PLURAL YIELD FIRF REFERENCIADO DI	1,1279%	0,3094	0,0002%	0,0106%	0,25%	229.159.851,44	22
20	BRADESCO FI RENDA FIXA CARDIAL	1,1266%	0,2653	0,0001%	0,0088%	0,00%	202.041.884,82	22
21	BAHIA AM FI RF REFERENCIADO DI	1,1245%	0,0416	0,0001%	0,0197%	0,25%	172.923.590,76	22
22	SANT FI BAIXO RISCO LIQUIDEZ RF REF DI	1,1234%	0,0029	0,0000%	0,0103%	0,10%	615.505.838,64	22
23	BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC FI RF LP	1,1230%	-0,0124	-0,0000%	0,0155%	0,20%	922.093.011,10	22
24	SAF SOBERANO REG PP II FC FI RF REF DI	1,1229%	-0,0363	-0,0000%	0,0077%	0,06%	6.069.341.716,27	22
25	BRADESCO H FI RF REF DI LP	1,1224%	-0,0298	-0,0000%	0,0210%	0,15%	520.468.980,03	22
26	FI RENDA FIXA PETROS LIQUIDEZ	1,1219%	-0,8469	-0,0001%	0,0012%	0,00%	5.155.879.925,28	22
27	ENERGY RF FI	1,1208%	-0,9624	-0,0001%	0,0018%	0,00%	3.120.545.095,43	22
28	SANTANDER RF CURTO PRAZO FI	1,1204%	-4,8200	-0,0001%	0,0004%	0,00%	1.143.120.269,55	22
29	BRAD H FI RF REF DI LP TITULOS PUBLICOS	1,1184%	-0,1650	-0,0002%	0,0211%	0,25%	713.359.043,18	22
30	SAFRA SOB REG PROPRIO FC FI RF REF DI	1,1135%	-0,9010	-0,0004%	0,0077%	0,15%	5.158.691.701,67	22
31	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	1,1118%	-0,2699	-0,0005%	0,0305%	0,15%	10.734.055.017,35	22
32	CREDIT SUISSE CASH FI MULT CRED PRIVADO	1,1111%	-2,0924	-0,0005%	0,0042%	0,10%	334.677.222,35	22
33	PARDO RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO	1,1110%	-4,6462	-0,0006%	0,0019%	0,10%	355.888.517,67	22
34	BNPP SOBERANO FC DE FI RF SIMPLES	1,1082%	-0,9226	-0,0007%	0,0117%	0,22%	625.345.290,64	22

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: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 50.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35	CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF CP	1,1023%	-13,0374	-0,0009%	0,0012%	0,20%	2.732.465.875,67	22
36	SANTANDER CASH RED FI RF REF DI	1,0862%	-45,6329	-0,0017%	0,0006%	0,40%	820.182.332,68	22
37	BRADESCO FI RF REF DI PERFORMANCE	1,0852%	-1,0762	-0,0017%	0,0253%	0,10%	134.950.678,27	22
38	BRADESCO FI RF REF DI ESTRELA	1,0756%	-2,4558	-0,0021%	0,0139%	1,00%	409.749.140,45	22
39	BRADESCO FI RF EMPRESA	1,0507%	-2,9381	-0,0033%	0,0176%	0,10%	59.916.685,43	22
40	BB PREVIDENCIARIO FLUXO RF SIMPLES FC FI	1,0442%	-2,0888	-0,0036%	0,0270%	1,00%	3.860.323.166,27	22
41	CAIXA FIC BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,9700%	-6,2752	-0,0069%	0,0175%	0,80%	900.415.296,74	22
	MÉDIA:	1,1205%	-1,9433	-0,0001%	0,0222%		7.586.383.585,58	