



Avaliação de Performance: RECKITT PREV
Plano de Benefícios

Fevereiro/2025

ReckittPREV CONSIDERAÇÕES – AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE (FEVEREIRO DE 2025)

RENTA FIXA

- **CARTEIRA INFLAÇÃO (WESTERN):** Esta carteira é composta, preponderantemente, por títulos públicos que serão mantidos até o vencimento, sendo, portanto, apreçados pela curva do papel. Dessa forma, limitamo-nos a comentar que o rendimento dos últimos doze meses, de 11,5%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 10,1%, que corresponde ao INPC acrescido de 5,00% ao ano.

- **CARTEIRA RENDA FIXA (WESTERN):** Nos últimos doze meses, o comportamento exibido por esta carteira de renda fixa poderia ter sido melhor. Isto porque, o retorno acumulado figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto. O desempenho mensal agradou. No mais, não podemos nos esquecer que o histórico construído pela Western em períodos mais longos seguiu prejudicado, em função, principalmente, dos impactos associados aos eventos de crédito de Lojas Americanas e de Light, contabilizados no início de 2023. Sendo assim, ainda nos parece prudente manter o gestor “em observação”.

RENTA VARIÁVEL

- **CARTEIRA RENDA VARIÁVEL (WESTERN):** Em fevereiro, a atuação da Western à frente desta carteira de renda variável nos pareceu aceitável. Nota-se que o retorno acumulado, por sinal negativo, praticamente alinhou-se ao IBrX-100 e ocupou o 10º lugar entre 25 possibilidades. Ao mesmo tempo, o risco total, o beta e o risco diversificável situaram-se abaixo da mediana da amostra. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, não se sobressaíram. Neste mês, há indícios de insucesso na seleção dos ativos e de sucesso em “timing”, sendo que ambos os fatores, alfa e gama, apresentaram baixa significância estatística. No mais, o histórico dos últimos doze meses e, principalmente, o de períodos mais longos, seguiu aquém do esperado. Sugere-se, portanto, que a Reckitt Prev retome as discussões quanto a substituição da Western neste segmento de aplicação.

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

- **CARTEIRA ESTRUTURADOS (ITAÚ):** Os recursos alocados nesta carteira encontram-se investidos, preponderantemente, no Itaú Global Dinâmico Multimercado FIC FI, cujo objetivo é fazer aplicações em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem em ativos financeiros de diferentes naturezas e características, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. O histórico dos últimos doze meses se sobressaiu, dado que o retorno acumulado, equivalente a 106,8% do CDI, foi o 7º melhor do agrupamento conservador, composto por 39 fundos. Ao mesmo tempo, o risco total se mostrou mediano, enquanto os índices de Sharpe e de Sortino, medidas de retorno ajustado por risco, agradaram. Por outro lado, o desempenho mensal poderia ter sido melhor, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS.

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

- **CARTEIRA EXTERIOR (WESTERN):** O histórico dos últimos doze meses desta carteira se mostrou razoável. Nota-se que o retorno acumulado, de 32,4%, figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto, sendo o 17º colocado entre 36 possíveis. Ao mesmo tempo, o risco total ocupou o 22º lugar, enquanto boa parte dos índices de retorno ajustado por risco se mostrou positiva, mas não se sobressaiu. O desempenho mensal não agradou, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS. Registra-se, ainda, que o histórico construído em algumas janelas de longo prazo permaneceu abaixo das expectativas, como, por exemplo, nos últimos trinta e seis meses. Sugere-se, portanto, manter o gestor “em observação”.

ReckittPREV CONSIDERAÇÕES – AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE (FEVEREIRO DE 2025)

CONSOLIDADO

- CARTEIRA CONSOLIDADA - (WESTERN) - Gestão Ativa: O rendimento obtido pela carteira consolidada nos últimos doze meses, de 10,7%, figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto, de 11,1. Em fevereiro, temos um resultado mais modesto, por conta da subtração de valor oriunda da exposição em renda variável e no exterior. No mais, cabe reiterar que a atuação do gestor em períodos mais longos, como, por exemplo, nos últimos trinta e seis meses, ainda requer atenção. Sendo assim, sugere-se que a Reckitt Prev: (i) permaneça vigilante as providências que estão sendo desenvolvidas para tentar reverter esta situação; e (ii) retome, quando possível, as discussões quanto à substituição da Western na renda variável.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – FEVEREIRO DE 2025

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	29.044.471,11	13,65%
Renda Fixa (Ativa)	147.507.878,74	69,32%
Renda Variável	9.609.997,98	4,51%
Estruturado	16.238.958,14	7,63%
Exterior	10.401.642,72	4,89%
Total	212.802.948,69	100,00%

Fonte: PPS

ReckittPREV

*Agrupamento: -.-
RENTA FIXA (Títulos na Curva)*

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - INFLAÇÃO (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%
BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 6,36899
PATRIMÔNIO: 29.044.471,11

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,55%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,41%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,04%

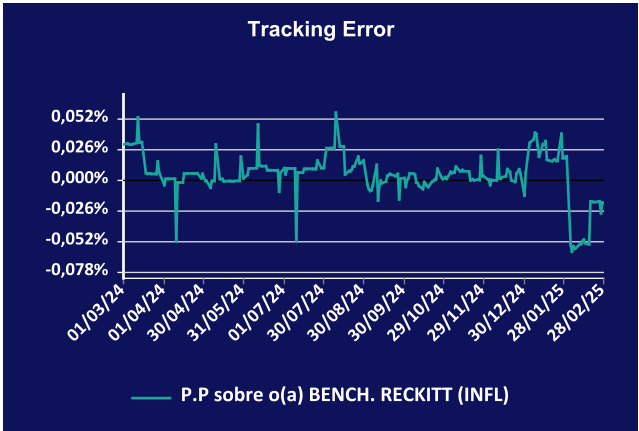
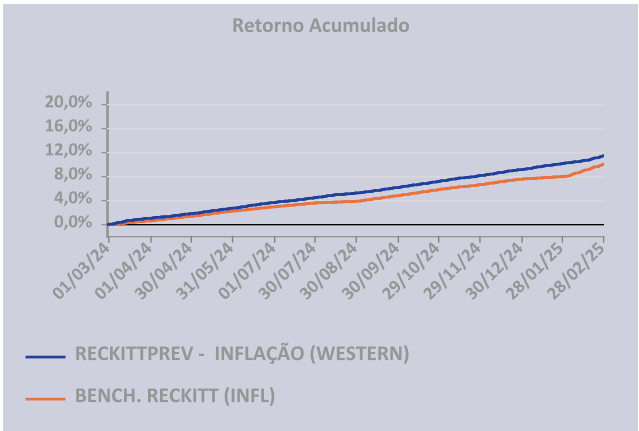
ESTILO: 6,70% | SELEÇÃO: 93,30%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0013%	--
RETORNO ACUMULADO	11,4991%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,1098%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,3893%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1148	--
SORTINO	0,1773	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,3579	--
DOWNSIDE RISK	0,0073%	--
RISCO ATIVO	0,0187%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2977%	--
RISCO TOTAL	0,0120%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1909%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	10
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1058%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7362%(08/2024)



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	1,11%	2,08%	11,50%	24,24%	39,82%	0,08% (12/03/2024)	-0,02% (10/07/2024)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,89%	2,31%	10,11%	20,08%	32,98%	0,09% (03/02/2025)	0,01% (01/08/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	-0,00% (01/08/2024)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	-0,01% (06/08/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - INFLAÇÃO (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%
BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 6,36899
PATRIMÔNIO: 29.044.471,11

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,75%	IRF-M	0,22%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,54%	DÓLAR PTAX	0,48%

ESTILO: 10,67%

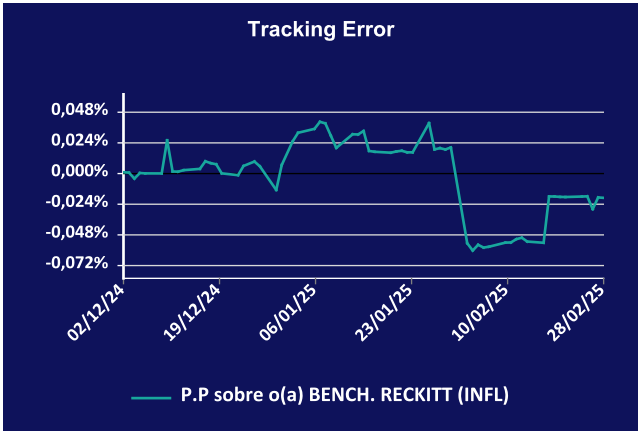
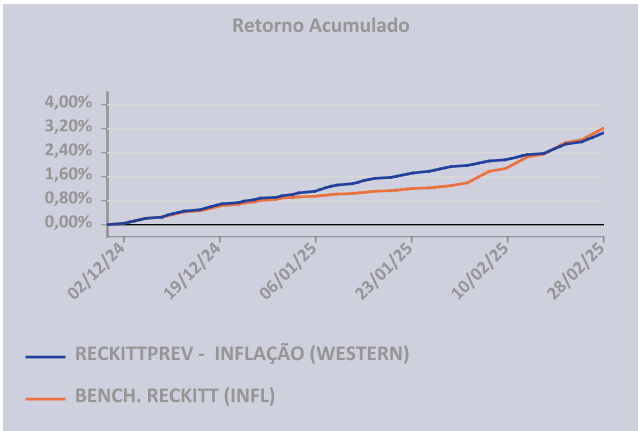
SELEÇÃO: 89,33%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0016%	--
RETORNO ACUMULADO	3,0629%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2184%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1555%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1275	--
SORTINO	0,2499	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,3213	--
DOWNSIDE RISK	0,0064%	--
RISCO ATIVO	0,0292%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,4638%	--
RISCO TOTAL	0,0130%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2066%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1058%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9624%(12/2024)



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	1,11%	2,08%	11,50%	24,24%	39,82%	0,08% (25/02/2025)	0,03% (30/12/2024)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,89%	2,31%	10,11%	20,08%	32,98%	0,09% (03/02/2025)	0,02% (02/01/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (10/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	1,94% (17/12/2024)	-1,72% (20/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - INFLAÇÃO (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%
BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 6,36899
PATRIMÔNIO: 29.044.471,11

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,27%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,07%	DÓLAR PTAX	1,65%

ESTILO: 23,28%

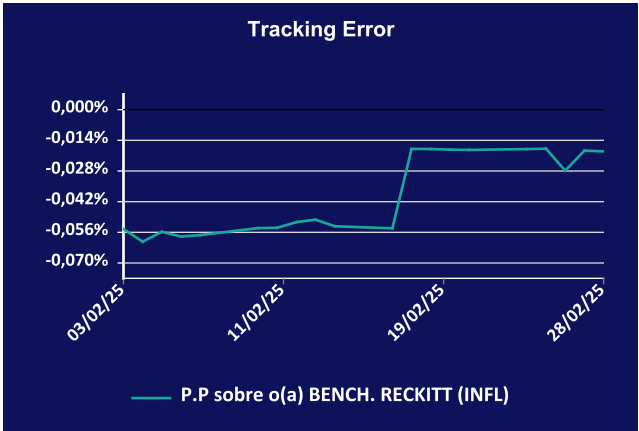
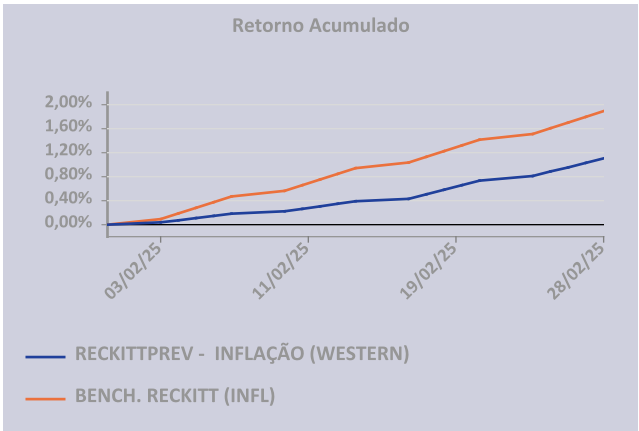
SELEÇÃO: 76,72%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0059%	--
RETORNO ACUMULADO	1,1057%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,8934%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7876%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,3248	--
SORTINO	0,7740	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,0148	--
DOWNSIDE RISK	0,0077%	--
RISCO ATIVO	0,0183%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2912%	--
RISCO TOTAL	0,0183%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2912%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1058%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	1,1058%(02/2025)



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	1,11%	2,08%	11,50%	24,24%	39,82%	0,08% (25/02/2025)	0,03% (04/02/2025)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,89%	2,31%	10,11%	20,08%	32,98%	0,09% (03/02/2025)	0,09% (03/02/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,05% (24/02/2025)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,43% (17/02/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,06% (12/02/2025)	0,04% (05/02/2025)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	0,73% (14/02/2025)	-0,57% (24/02/2025)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,23% (14/02/2025)	-0,19% (04/02/2025)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,12% (14/02/2025)	-0,93% (24/02/2025)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,29% (14/02/2025)	-0,14% (26/02/2025)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	0,07% (03/02/2025)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	0,07% (03/02/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	0,91% (25/02/2025)	-1,30% (04/02/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: -.-
RENTA FIXA*

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,59754
PATRIMÔNIO: 147.507.878,74

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	73,68%	IRF-M	4,88%
IMA B 5	20,77%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,66%	DÓLAR PTAX	0,00%

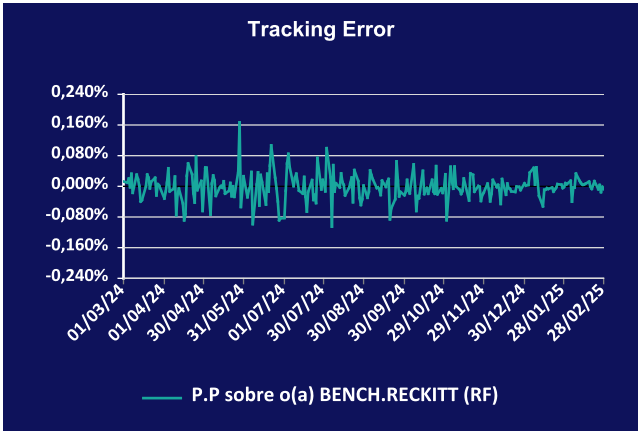
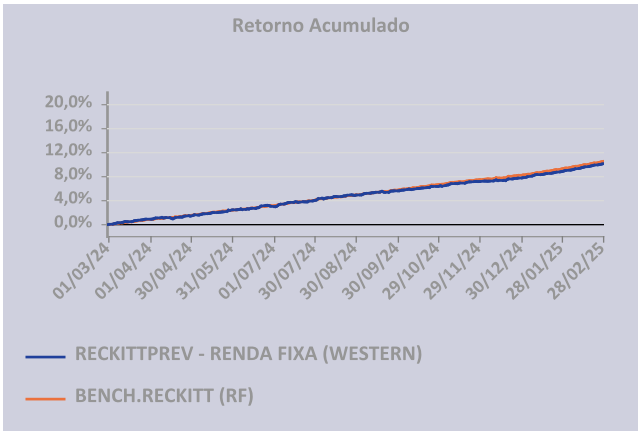
ESTILO: 62,41% | SELEÇÃO: 37,59%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0034%	--
RETORNO ACUMULADO	10,1699%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,5639%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,3939%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0692	--
SORTINO	-0,0908	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,6349	--
DOWNSIDE RISK	0,0375%	--
RISCO ATIVO	0,0346%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,5508%	--
RISCO TOTAL	0,0493%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7834%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	6
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	6
MAIOR RETORNO MENSAL	1,0933%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,5004%(04/2024)



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	1,06%	2,16%	10,17%	24,97%	36,80%	0,21% (28/05/2024)	-0,11% (06/08/2024)
BENCH.RECKITT (RF)	1,02%	2,09%	10,56%	24,35%	40,36%	0,15% (19/12/2024)	-0,05% (12/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	-0,00% (01/08/2024)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	-0,01% (05/08/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,59754
PATRIMÔNIO: 147.507.878,74

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	82,72%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	13,01%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	3,88%	DÓLAR PTAX	0,39%

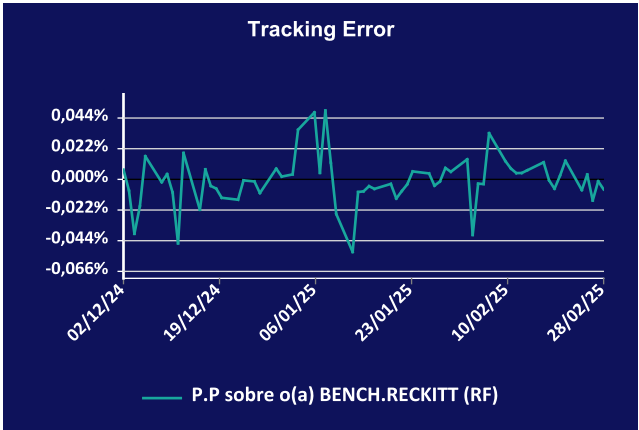
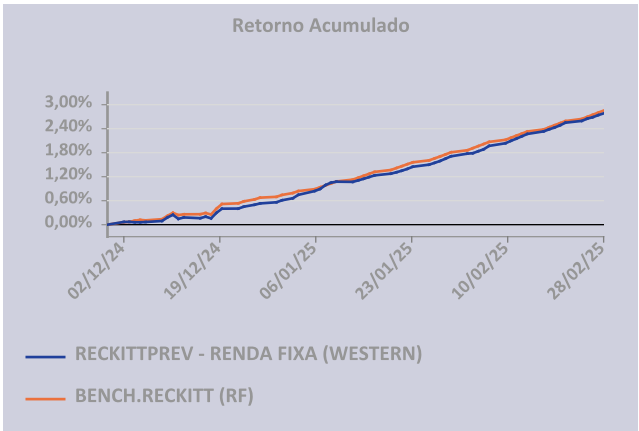
ESTILO: 69,90% | SELEÇÃO: 30,10%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0027%	--
RETORNO ACUMULADO	2,7829%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,8529%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0699%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0789	--
SORTINO	-0,0977	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,8183	--
DOWNSIDE RISK	0,0276%	--
RISCO ATIVO	0,0179%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2857%	--
RISCO TOTAL	0,0347%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,5515%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	2
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,0933%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,6095%(12/2024)



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	1,06%	2,16%	10,17%	24,97%	36,80%	0,14% (19/12/2024)	-0,10% (12/12/2024)
BENCH.RECKITT (RF)	1,02%	2,09%	10,56%	24,35%	40,36%	0,15% (19/12/2024)	-0,05% (12/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (10/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	1,94% (17/12/2024)	-1,72% (20/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,59754
PATRIMÔNIO: 147.507.878,74

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	89,88%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	7,15%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	2,19%	DÓLAR PTAX	0,78%

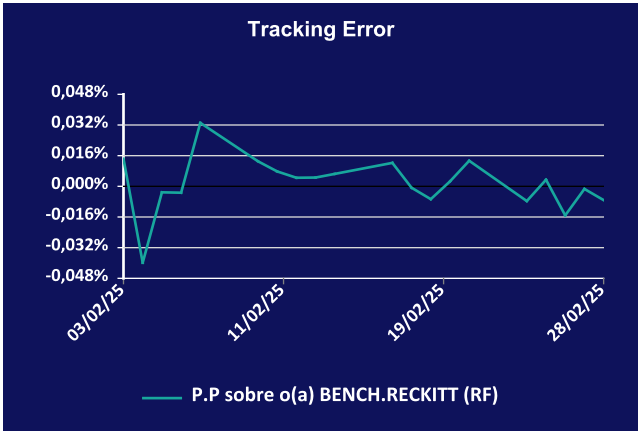
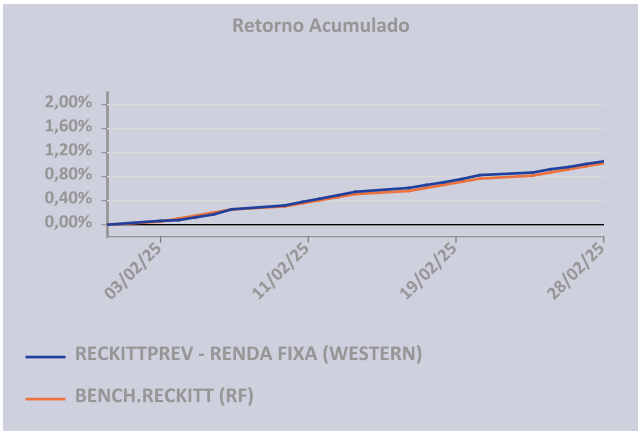
ESTILO: 61,86% | SELEÇÃO: 38,14%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0034%	--
RETORNO ACUMULADO	1,0553%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0247%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0306%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,2423	--
SORTINO	0,3763	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,8313	--
DOWNSIDE RISK	0,0092%	--
RISCO ATIVO	0,0143%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2278%	--
RISCO TOTAL	0,0143%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2274%	--

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	1,0554%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	1,0554%(02/2025)



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	1,06%	2,16%	10,17%	24,97%	36,80%	0,08% (07/02/2025)	0,01% (04/02/2025)
BENCH.RECKITT (RF)	1,02%	2,09%	10,56%	24,35%	40,36%	0,05% (27/02/2025)	0,05% (03/02/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,05% (24/02/2025)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,43% (17/02/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA-S	0,99%	2,11%	11,43%	25,81%	42,36%	0,06% (12/02/2025)	0,04% (05/02/2025)
IMA-B	0,50%	1,58%	-1,00%	13,55%	22,57%	0,73% (14/02/2025)	-0,57% (24/02/2025)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,23% (14/02/2025)	-0,19% (04/02/2025)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,12% (14/02/2025)	-0,93% (24/02/2025)
IMA-GERAL	0,79%	2,20%	6,23%	21,20%	33,94%	0,29% (14/02/2025)	-0,14% (26/02/2025)
IPCA	1,31%	1,47%	5,06%	9,78%	15,93%	0,07% (03/02/2025)	0,07% (03/02/2025)
INPC	1,48%	1,48%	4,87%	8,92%	14,87%	0,07% (03/02/2025)	0,07% (03/02/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	0,91% (25/02/2025)	-1,30% (04/02/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%
BENCHMARK: IBX

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,14384
PATRIMÔNIO: 9.609.997,98

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	3,80%	IBX	90,57%
IVBX-2	3,65%	SMLL	1,72%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,25%
IMA-B	0,00%		

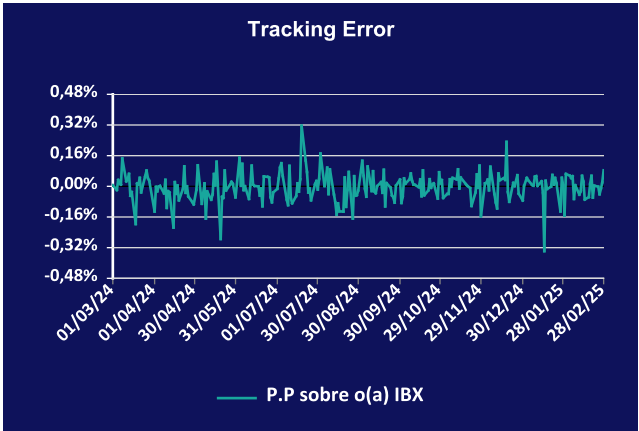
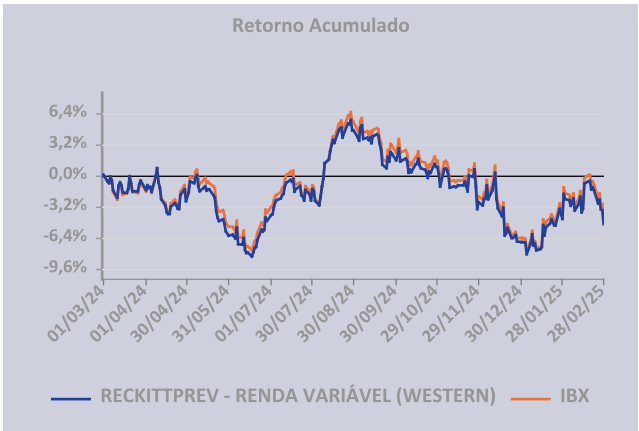
ESTILO: 99,41% | SELEÇÃO: 0,59%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0579%	15° de 25
RETORNO ACUMULADO	-4,9208%	15° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	-4,3808%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5400%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0017%	12° de 25
BETA	0,9675	23° de 25
MARKET TIMING	-0,3357	20° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9933	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	27,9329%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	69,7349%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,5257	15° de 25
JENSEN	-1,0379%	15° de 25
MODIGLIANI	-1,0168%	15° de 25
SHARPE	-0,0694	15° de 25
SORTINO	-0,0927	15° de 25
TREYNOR	-0,0005	15° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,1774	--
DOWNSIDE RISK	0,6247%	19° de 25
RISCO ATIVO	0,0736%	12° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,1686%	12° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0682%	11° de 25
RISCO TOTAL	0,8347%	23° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,2517%	23° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	4
MESES NEGATIVOS	8
MESES ACIMA DO IBX	7
MESES ABAIXO DO IBX	5
MAIOR RETORNO MENSAL	6,1043%(08/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	-4,2034%(12/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-2,64%	1,98%	-4,92%	14,54%	4,90%	2,68% (30/01/2025)	-2,93% (18/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%
BENCHMARK: IBX

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,14384
PATRIMÔNIO: 9.609.997,98

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	4,71%	IBX	92,19%
IVBX-2	0,89%	SMLL	0,00%
IDIV	2,22%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,00%		

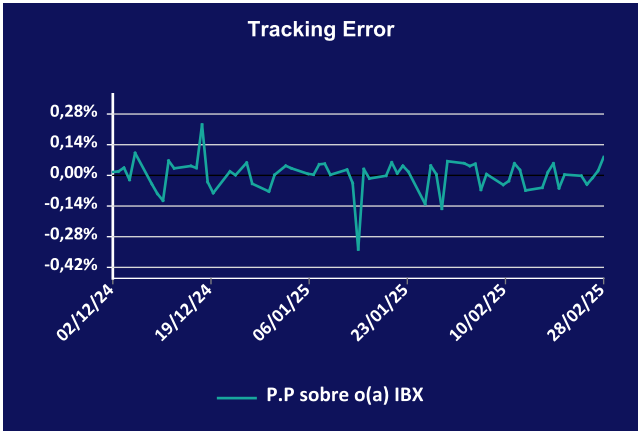
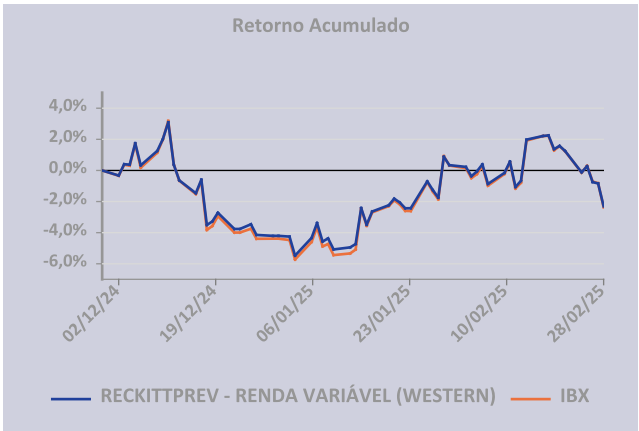
ESTILO: 99,79% | SELEÇÃO: 0,21%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0775%	18° de 25
RETORNO ACUMULADO	-2,3054%	18° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	-2,3720%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0665%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0018%	8° de 25
BETA	0,9516	22° de 25
MARKET TIMING	-0,4017	24° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9980	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	20,2087%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	83,6172%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,1078	18° de 25
JENSEN	-0,1905%	18° de 25
MODIGLIANI	-0,1944%	21° de 25
SHARPE	-0,0717	21° de 25
SORTINO	-0,0972	19° de 25
TREYNOR	-0,0008	20° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	9,5400	--
DOWNSIDE RISK	0,7973%	21° de 25
RISCO ATIVO	0,0734%	13° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,1653%	13° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0489%	12° de 25
RISCO TOTAL	1,0811%	23° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,1630%	23° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO IBX	2
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	4,7438%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-4,2034%(12/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-2,64%	1,98%	-4,92%	14,54%	4,90%	2,68% (30/01/2025)	-2,93% (18/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (10/12/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)
GESTOR: WESTERN ASSET
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%
BENCHMARK: IBX

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,14384
PATRIMÔNIO: 9.609.997,98

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	3,01%	IBX	94,85%
IVBX-2	2,14%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,00%		

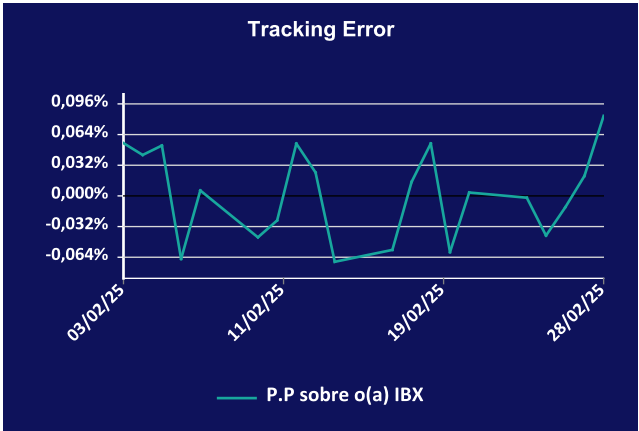
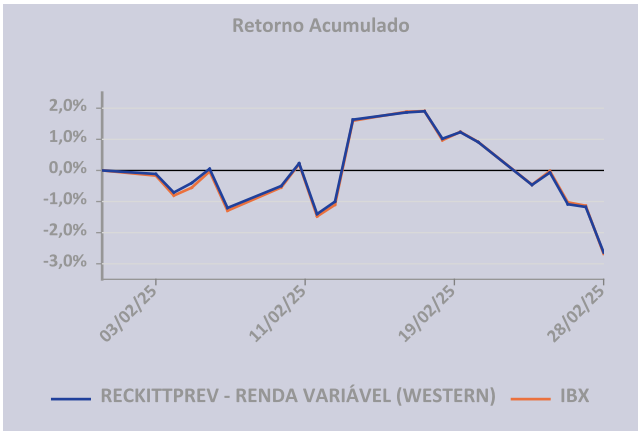
ESTILO: 99,88% | SELEÇÃO: 0,12%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1778%	12° de 25
RETORNO ACUMULADO	-2,6374%	10° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	-2,6807%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0433%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0048%	18° de 25
BETA	0,9698	20° de 25
MARKET TIMING	0,1283	11° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9987	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	35,7135%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	19,4083%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,6541	13° de 25
JENSEN	-0,0656%	17° de 25
MODIGLIANI	-0,0653%	20° de 25
SHARPE	-0,1775	20° de 25
SORTINO	-0,2353	18° de 25
TREYNOR	-0,0018	17° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,6167	--
DOWNSIDE RISK	0,7555%	21° de 25
RISCO ATIVO	0,0469%	13° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,7448%	13° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0354%	13° de 25
RISCO TOTAL	1,0016%	20° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	15,9004%	20° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	0
MAIOR RETORNO MENSAL	-2,6375%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-2,6375%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-2,64%	1,98%	-4,92%	14,54%	4,90%	2,66% (14/02/2025)	-1,63% (12/02/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,05% (24/02/2025)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,70% (14/02/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,73% (14/02/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,51% (14/02/2025)	-1,54% (24/02/2025)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,06% (14/02/2025)	-2,14% (24/02/2025)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-1,81% (12/02/2025)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025
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	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,6075%	0,9926	-3,6745%	13,5549%	0,31%	95.168.224,87	254
2	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,4585%	0,9972	-3,8773%	13,6045%	0,10%	440.855.723,33	254
3	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,4580%	0,9949	-3,8502%	13,5795%	0,09%	264.013.230,07	254
4	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,4416%	0,9986	-3,9175%	13,6257%	0,15%	172.849.951,82	254
5	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,3876%	0,9697	-3,6411%	13,3277%	0,15%	163.978.240,51	254
6	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,3762%	0,9944	-3,9235%	13,5723%	0,01%	264.061.212,93	254
7	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,2590%	0,9988	-4,1024%	13,6280%	0,30%	79.245.900,22	254
8	FIA VALUE PREV IBRX	0,1889%	0,9943	-4,1042%	13,5672%	0,09%	25.077.189,31	254
9	COMSHELL CONCHA FIA	0,1312%	0,9804	-3,9467%	13,3766%	0,17%	56.858.153,61	254
10	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0931%	0,9850	-4,0568%	13,4409%	0,56%	22.984.253,75	254
11	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0337%	0,9388	-3,3999%	12,8103%	0,30%	30.447.472,69	254
12	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,1210%	0,9706	-4,0601%	13,2599%	0,00%	152.223.639,43	254
13	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,4740%	0,9772	-4,5023%	13,3445%	0,50%	33.553.064,16	254
14	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,8213%	0,9946	-5,1596%	13,6099%	0,90%	155.526.460,84	254
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-1,0168%	0,9675	-4,9209%	13,2518%	0,35%	9.609.997,98	254
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-1,2775%	0,9449	-4,7764%	12,9286%	0,75%	26.329.648,85	254
17	IAJA SAM ACOES FI	-2,2615%	1,0022	-6,7943%	13,7620%	0,22%	27.524.799,31	254
18	DAHLIA ACOES FC FIA	-2,3691%	0,9717	-7,7638%	14,4191%	1,85%	66.038.409,41	254
19	IAJA ACOES FC FIA	-3,1990%	0,9892	-7,6192%	13,6741%	0,08%	64.556.622,40	254
20	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-3,4629%	1,1617	-12,5295%	17,0151%	1,70%	18.808.651,13	254
21	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,6849%	1,0156	-8,4346%	13,9076%	0,70%	10.962.979,72	254
22	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,9455%	1,0548	-10,0607%	14,8617%	2,00%	207.208.343,72	254
23	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-4,0432%	1,0539	-10,1493%	14,8493%	2,00%	525.480.723,26	254
24	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-4,4643%	1,0459	-10,7279%	14,9315%	0,41%	214.564.455,16	254
25	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-5,3033%	1,0521	-11,7496%	14,9994%	0,75%	25.223.588,43	254
MÉDIA:		-1,3204%	1,0019	-6,0697%	13,8761%		126.126.037,48	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025
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	IAJA SAM ACOES FI	0,3789%	1,0021	-2,0288%	18,1441%	0,22%	27.524.799,31	63
2	DAHLIA ACOES FC FIA	0,3715%	1,0324	-2,2936%	19,0791%	1,85%	66.038.409,41	63
3	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,2925%	0,9967	-2,0630%	17,9551%	0,10%	440.855.723,33	63
4	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,2678%	0,9257	-1,7284%	16,6773%	0,30%	30.447.472,69	63
5	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,2550%	0,9842	-2,0371%	17,7308%	0,56%	22.984.253,75	63
6	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,2254%	0,9978	-2,1363%	17,9779%	0,09%	264.013.230,07	63
7	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,2099%	0,9976	-2,1508%	17,9743%	0,01%	264.061.212,93	63
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,2009%	0,9405	-1,9374%	17,1933%	0,15%	163.978.240,51	63
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,1971%	0,9989	-2,1694%	17,9947%	0,15%	172.849.951,82	63
10	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,1676%	0,9993	-2,2010%	18,0024%	0,31%	95.168.224,87	63
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,1571%	0,9987	-2,2082%	17,9909%	0,30%	79.245.900,22	63
12	FIA VALUE PREV IBRX	0,1336%	0,9928	-2,2011%	17,8847%	0,09%	25.077.189,31	63
13	COMSHELL CONCHA FIA	0,1293%	0,9793	-2,1349%	17,6410%	0,17%	56.858.153,61	63
14	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,0844%	0,9765	-2,1683%	17,6046%	0,90%	155.526.460,84	63
15	BRADESCO FIA SALUBRE	0,0643%	0,9608	-2,1018%	17,3098%	0,50%	33.553.064,16	63
16	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,0557%	1,1224	-3,1668%	20,9185%	0,41%	214.564.455,16	63
17	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,0331%	0,9625	-2,1429%	17,3474%	0,00%	152.223.639,43	63
18	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,0082%	1,1144	-3,1846%	20,7922%	0,75%	25.223.588,43	63
19	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-0,1041%	1,1049	-3,2138%	20,4593%	2,00%	207.208.343,72	63
20	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,1892%	1,1038	-3,3033%	20,4360%	2,00%	525.480.723,26	63
21	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-0,1945%	0,9517	-2,3055%	17,1631%	0,35%	9.609.997,98	63
22	IAJA ACOES FC FIA	-0,2094%	0,9933	-2,5931%	18,0523%	0,08%	64.556.622,40	63
23	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,2557%	0,9361	-2,2767%	16,8822%	0,75%	26.329.648,85	63
24	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,6169%	1,0020	-3,0218%	18,1138%	0,70%	10.962.979,72	63
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-1,8917%	1,0732	-4,9772%	19,7939%	1,70%	18.808.651,13	63
MÉDIA:		-0,0092%	1,0059	-2,4698%	18,2847%		126.126.037,48	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/02/2025 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES
PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA
APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO MODIGLIANI
PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	MODIGLIANI	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,5511%	1,0946	-2,5981%	18,8397%	0,75%	25.223.588,43	20
2	DAHLIA ACOES FC FIA	0,4844%	1,0748	-2,5136%	18,0103%	1,85%	66.038.409,41	20
3	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,3719%	1,0953	-2,7911%	18,7749%	0,41%	214.564.455,16	20
4	RPS FIC FI ACOES SELECTION	0,2795%	1,1594	-3,0183%	19,3615%	1,70%	18.808.651,13	20
5	IAJA SAM ACOES FI	0,2340%	0,9826	-2,4075%	16,1903%	0,22%	27.524.799,31	20
6	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0376%	0,9984	-2,6368%	16,3486%	0,10%	440.855.723,33	20
7	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,0303%	0,9966	-2,6376%	16,3197%	0,09%	264.013.230,07	20
8	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0300%	1,0004	-2,6514%	16,3803%	0,15%	172.849.951,82	20
9	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,0272%	0,9964	-2,6400%	16,3164%	0,01%	264.061.212,93	20
10	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,0181%	0,9988	-2,6562%	16,3482%	0,31%	95.168.224,87	20
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0165%	1,0001	-2,6638%	16,3750%	0,30%	79.245.900,22	20
12	COMSHELL CONCHA FIA	0,0082%	0,9815	-2,6051%	16,0752%	0,17%	56.858.153,61	20
13	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0001%	0,9850	-2,6290%	16,1467%	0,56%	22.984.253,75	20
14	FIA VALUE PREV IBRX	-0,0009%	0,9848	-2,6235%	16,1177%	0,09%	25.077.189,31	20
15	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,0133%	0,9912	-2,6605%	16,2281%	0,50%	33.553.064,16	20
16	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0301%	0,9222	-2,4210%	15,0930%	0,30%	30.447.472,69	20
17	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,0321%	1,0611	-3,0824%	18,0142%	2,00%	525.480.723,26	20
18	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-0,0331%	1,0691	-3,1114%	18,1375%	2,00%	207.208.343,72	20
19	IAJA ACOES FC FIA	-0,0404%	0,9489	-2,5675%	15,6985%	0,08%	64.556.622,40	20
20	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-0,0654%	0,9698	-2,6375%	15,9004%	0,35%	9.609.997,98	20
21	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,0714%	0,9698	-2,6433%	15,9004%	0,00%	152.223.639,43	20
22	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,1558%	0,9930	-2,8218%	16,3144%	0,90%	155.526.460,84	20
23	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,1566%	0,9516	-2,6595%	15,6156%	0,75%	26.329.648,85	20
24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-0,4053%	0,8708	-2,6859%	14,7679%	0,15%	163.978.240,51	20
25	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,4588%	1,0016	-3,1907%	16,5806%	0,70%	10.962.979,72	20
MÉDIA:		0,0250%	1,0039	-2,7021%	16,6342%		126.126.037,48	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL

PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,3999%	0,0259%	0,9388	12,8103%	0,30%	30.447.472,69	254
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-3,6411%	0,2844%	0,9697	13,3277%	0,15%	163.978.240,51	254
3	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	-3,6745%	0,5898%	0,9926	13,5549%	0,31%	95.168.224,87	254
4	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-3,8502%	0,4507%	0,9949	13,5795%	0,09%	264.013.230,07	254
5	SANTANDER FI IBRX ACOES	-3,8773%	0,4565%	0,9972	13,6045%	0,10%	440.855.723,33	254
6	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-3,9175%	0,4404%	0,9986	13,6257%	0,15%	172.849.951,82	254
7	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-3,9235%	0,3691%	0,9944	13,5723%	0,01%	264.061.212,93	254
8	COMSHELL CONCHA FIA	-3,9467%	0,1278%	0,9804	13,3766%	0,17%	56.858.153,61	254
9	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-4,0568%	0,0866%	0,9850	13,4409%	0,56%	22.984.253,75	254
10	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-4,0601%	-0,1366%	0,9706	13,2599%	0,00%	152.223.639,43	254
11	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-4,1024%	0,2582%	0,9988	13,6280%	0,30%	79.245.900,22	254
12	FIA VALUE PREV IBRX	-4,1042%	0,1872%	0,9943	13,5672%	0,09%	25.077.189,31	254
13	BRADESCO FIA SALUBRE	-4,5023%	-0,4813%	0,9772	13,3445%	0,50%	33.553.064,16	254
14	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-4,7764%	-1,2520%	0,9449	12,9286%	0,75%	26.329.648,85	254
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-4,9209%	-1,0379%	0,9675	13,2518%	0,35%	9.609.997,98	254
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-5,1596%	-0,8632%	0,9946	13,6099%	0,90%	155.526.460,84	254
17	IAJA SAM ACOES FI	-6,7943%	-2,3840%	1,0022	13,7620%	0,22%	27.524.799,31	254
18	IAJA ACOES FC FIA	-7,6192%	-3,4105%	0,9892	13,6741%	0,08%	64.556.622,40	254
19	DAHLIA ACOES FC FIA	-7,7638%	-3,7950%	0,9717	14,4191%	1,85%	66.038.409,41	254
20	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-8,4346%	-3,8227%	1,0156	13,9076%	0,70%	10.962.979,72	254
21	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-10,0607%	-4,8463%	1,0548	14,8617%	2,00%	207.208.343,72	254
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-10,1493%	-4,9463%	1,0539	14,8493%	2,00%	525.480.723,26	254
23	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-10,7279%	-5,6108%	1,0459	14,9315%	0,41%	214.564.455,16	254
24	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-11,7496%	-6,5425%	1,0521	14,9994%	0,75%	25.223.588,43	254
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-12,5295%	-5,6145%	1,1617	17,0151%	1,70%	18.808.651,13	254
MÉDIA:		-6,0697%	-1,6587%	1,0019	13,8761%		126.126.037,48	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/12/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL

PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-1,7284%	0,2469%	0,9257	16,6773%	0,30%	30.447.472,69	63
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-1,9374%	0,1195%	0,9405	17,1933%	0,15%	163.978.240,51	63
3	IAJA SAM ACOES FI	-2,0288%	0,3532%	1,0021	18,1441%	0,22%	27.524.799,31	63
4	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-2,0371%	0,2497%	0,9842	17,7308%	0,56%	22.984.253,75	63
5	SANTANDER FI IBRX ACOES	-2,0630%	0,2913%	0,9967	17,9551%	0,10%	440.855.723,33	63
6	BRADESCO FIA SALUBRE	-2,1018%	0,0603%	0,9608	17,3098%	0,50%	33.553.064,16	63
7	COMSHELL CONCHA FIA	-2,1349%	0,1265%	0,9793	17,6410%	0,17%	56.858.153,61	63
8	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-2,1363%	0,2238%	0,9978	17,9779%	0,09%	264.013.230,07	63
9	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-2,1429%	0,0291%	0,9625	17,3474%	0,00%	152.223.639,43	63
10	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-2,1508%	0,2083%	0,9976	17,9743%	0,01%	264.061.212,93	63
11	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-2,1683%	0,0780%	0,9765	17,6046%	0,90%	155.526.460,84	63
12	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-2,1694%	0,1967%	0,9989	17,9947%	0,15%	172.849.951,82	63
13	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	-2,2010%	0,1673%	0,9993	18,0024%	0,31%	95.168.224,87	63
14	FIA VALUE PREV IBRX	-2,2011%	0,1324%	0,9928	17,8847%	0,09%	25.077.189,31	63
15	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-2,2082%	0,1568%	0,9987	17,9909%	0,30%	79.245.900,22	63
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,2767%	-0,2456%	0,9361	16,8822%	0,75%	26.329.648,85	63
17	DAHLIA ACOES FC FIA	-2,2936%	0,2505%	1,0324	19,0791%	1,85%	66.038.409,41	63
18	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-2,3055%	-0,1905%	0,9517	17,1631%	0,35%	9.609.997,98	63
19	IAJA ACOES FC FIA	-2,5931%	-0,2576%	0,9933	18,0523%	0,08%	64.556.622,40	63
20	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,0218%	-0,6408%	1,0020	18,1138%	0,70%	10.962.979,72	63
21	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-3,1668%	-0,1418%	1,1224	20,9185%	0,41%	214.564.455,16	63
22	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-3,1846%	-0,2020%	1,1144	20,7922%	0,75%	25.223.588,43	63
23	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,2138%	-0,2847%	1,1049	20,4593%	2,00%	207.208.343,72	63
24	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-3,3033%	-0,3802%	1,1038	20,4360%	2,00%	525.480.723,26	63
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-4,9772%	-2,2159%	1,0732	19,7939%	1,70%	18.808.651,13	63
MÉDIA:		-2,4698%	-0,0667%	1,0059	18,2847%		126.126.037,48	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO:AÇÕES

PERIODICIDADE DE RETORNOS:DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA:LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO:DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL

PORTE SELECIONADO:PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	IAJA SAM ACOES FI	-2,4075%	0,2065%	0,9826	16,1903%	0,22%	27.524.799,31	20
2	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-2,4210%	-0,0280%	0,9222	15,0930%	0,30%	30.447.472,69	20
3	DAHLIA ACOES FC FIA	-2,5136%	0,3994%	1,0748	18,0103%	1,85%	66.038.409,41	20
4	IAJA ACOES FC FIA	-2,5675%	-0,0739%	0,9489	15,6985%	0,08%	64.556.622,40	20
5	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-2,5981%	0,4351%	1,0946	18,8397%	0,75%	25.223.588,43	20
6	COMSHELL CONCHA FIA	-2,6051%	0,0080%	0,9815	16,0752%	0,17%	56.858.153,61	20
7	FIA VALUE PREV IBRX	-2,6235%	-0,0009%	0,9848	16,1177%	0,09%	25.077.189,31	20
8	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-2,6290%	-0,0004%	0,9850	16,1467%	0,56%	22.984.253,75	20
9	SANTANDER FI IBRX ACOES	-2,6368%	0,0375%	0,9984	16,3486%	0,10%	440.855.723,33	20
10	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-2,6375%	-0,0657%	0,9698	15,9004%	0,35%	9.609.997,98	20
11	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-2,6376%	0,0302%	0,9966	16,3197%	0,09%	264.013.230,07	20
12	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-2,6400%	0,0271%	0,9964	16,3164%	0,01%	264.061.212,93	20
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-2,6433%	-0,0715%	0,9698	15,9004%	0,00%	152.223.639,43	20
14	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-2,6514%	0,0300%	1,0004	16,3803%	0,15%	172.849.951,82	20
15	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	-2,6562%	0,0180%	0,9988	16,3482%	0,31%	95.168.224,87	20
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,6595%	-0,1537%	0,9516	15,6156%	0,75%	26.329.648,85	20
17	BRADESCO FIA SALUBRE	-2,6605%	-0,0134%	0,9912	16,2281%	0,50%	33.553.064,16	20
18	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-2,6638%	0,0164%	1,0001	16,3750%	0,30%	79.245.900,22	20
19	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-2,6859%	-0,4765%	0,8708	14,7679%	0,15%	163.978.240,51	20
20	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-2,7911%	0,2458%	1,0953	18,7749%	0,41%	214.564.455,16	20
21	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-2,8218%	-0,1585%	0,9930	16,3144%	0,90%	155.526.460,84	20
22	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-3,0183%	0,2411%	1,1594	19,3615%	1,70%	18.808.651,13	20
23	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-3,0824%	-0,1614%	1,0611	18,0142%	2,00%	525.480.723,26	20
24	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,1114%	-0,1626%	1,0691	18,1375%	2,00%	207.208.343,72	20
25	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,1907%	-0,4947%	1,0016	16,5806%	0,70%	10.962.979,72	20
MÉDIA:		-2,7021%	-0,0066%	1,0039	16,6342%		126.126.037,48	

ReckittPREV

*Agrupamento: Multimercados
CONSERVADOR*

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)
GESTOR: -.-
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,30%
BENCHMARK: CDI

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,18532
PATRIMÔNIO: 16.238.958,14

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	94,96%	IBOVESPA	2,84%
IVBX-2	0,81%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,39%	DÓLAR PTAX	0,00%

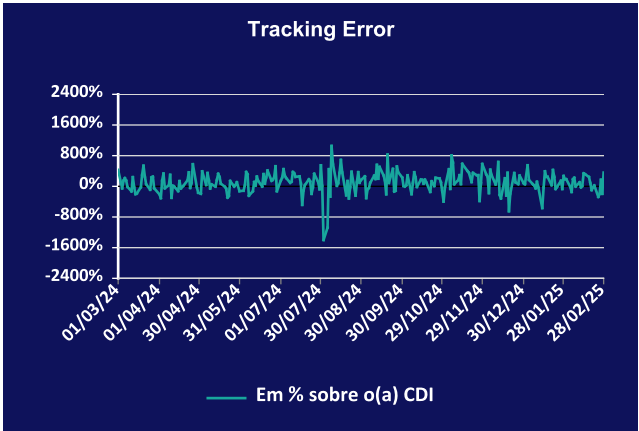
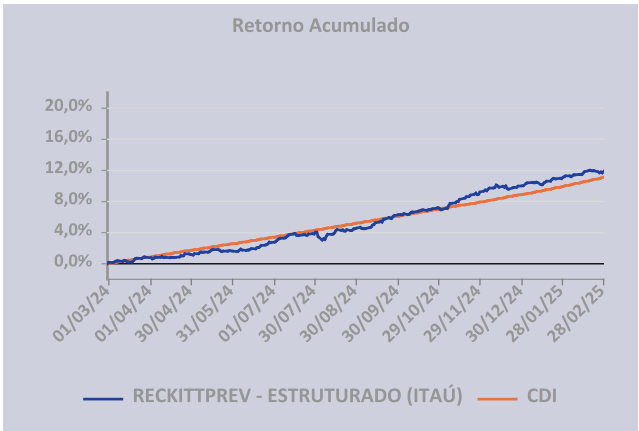
ESTILO: 8,58% | SELEÇÃO: 91,42%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0027%	7° de 39
RETORNO ACUMULADO	11,8880%	7° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,1307%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	106,8036%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0019	6° de 39
SHARPE	0,0245	6° de 39
SORTINO	0,0336	7° de 39
STERLING RATIO	0,0228	6° de 39
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,9023	--
DOWNSIDE RISK	0,0813%	22° de 39
RISCO ATIVO	271,6567%	21° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,7698%	20° de 39
RISCO TOTAL	0,1113%	20° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7677%	20° de 39

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO CDI	6
MESES ABAIXO DO CDI	6
MAIOR RETORNO MENSAL	2,0997%(11/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	0,3488%(04/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,53%	1,67%	11,89%	--	--	0,41% (08/08/2024)	-0,55% (02/08/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)
GESTOR: -.-
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,30%
BENCHMARK: CDI

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,18532
PATRIMÔNIO: 16.238.958,14

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,78%	IBOVESPA	0,56%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,65%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

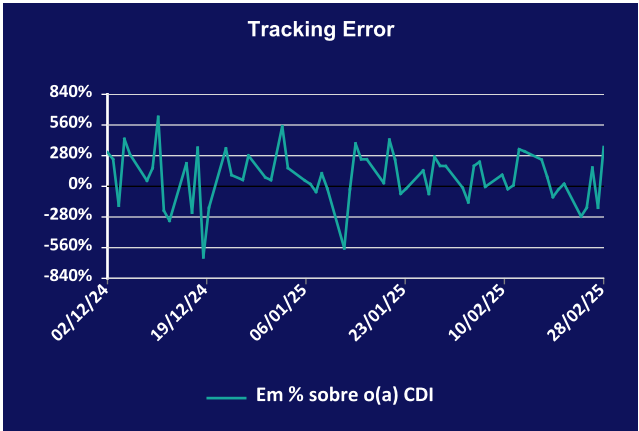
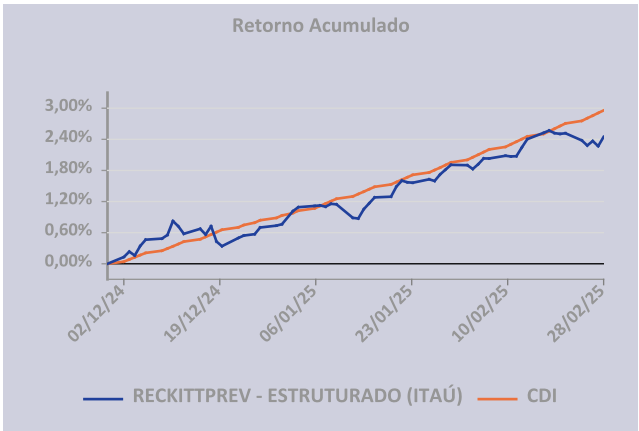
ESTILO: 2,20% | SELEÇÃO: 97,80%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0078%	23° de 39
RETORNO ACUMULADO	2,4489%	23° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,9586%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	82,7719%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0125	16° de 36
SHARPE	-0,0714	18° de 39
SORTINO	-0,0909	18° de 39
STERLING RATIO	-0,0649	18° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,5377	--
DOWNSIDE RISK	0,0860%	17° de 39
RISCO ATIVO	239,9058%	18° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,7388%	17° de 39
RISCO TOTAL	0,1091%	17° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7330%	17° de 39

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO CDI	1
MESES ABAIXO DO CDI	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1363%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,5306%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,53%	1,67%	11,89%	--	--	0,27% (11/12/2024)	-0,29% (19/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (10/12/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	1,94% (17/12/2024)	-1,72% (20/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A
CÓD. ANBIMA: N/A
NOME FANTASIA: RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)
GESTOR: -.-
ADMINISTRADOR: -.-
CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,30%
BENCHMARK: CDI

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,18532
PATRIMÔNIO: 16.238.958,14

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	93,43%	IBOVESPA	0,62%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,43%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	5,52%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

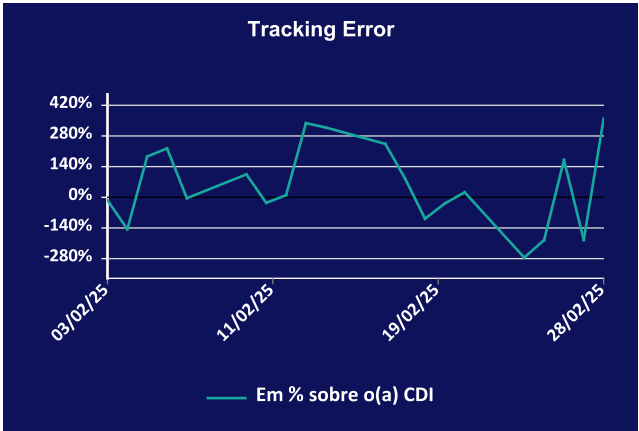
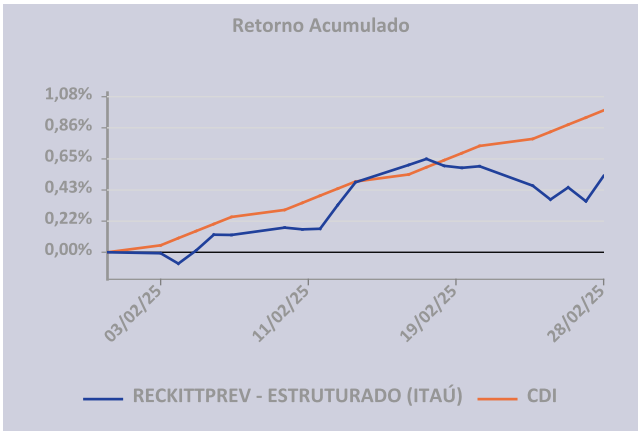
ESTILO: 13,58% | SELEÇÃO: 86,42%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0225%	29° de 39
RETORNO ACUMULADO	0,5305%	29° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9853%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	53,8489%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0834	24° de 33
SHARPE	-0,2463	25° de 39
SORTINO	-0,2954	26° de 39
STERLING RATIO	-0,2803	25° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,8206	--
DOWNSIDE RISK	0,0762%	17° de 39
RISCO ATIVO	186,6747%	17° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,4522%	17° de 39
RISCO TOTAL	0,0914%	17° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4524%	17° de 39

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO CDI	0
MESES ABAIXO DO CDI	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,5306%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,5306%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,53%	1,67%	11,89%	--	--	0,18% (28/02/2025)	-0,13% (24/02/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,05% (24/02/2025)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,70% (14/02/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,73% (14/02/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,51% (14/02/2025)	-1,54% (24/02/2025)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,06% (14/02/2025)	-2,14% (24/02/2025)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-1,81% (12/02/2025)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,43% (17/02/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,23% (14/02/2025)	-0,19% (04/02/2025)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,12% (14/02/2025)	-0,93% (24/02/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	0,91% (25/02/2025)	-1,30% (04/02/2025)

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: 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	ITAU HEDGE MULT FI	0,0741	14,3061%	0,0112%	2,4000%	2,00%	252.918.915,49	254
2	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,0657	13,8728%	0,0097%	2,3434%	2,50%	61.908.884,54	254
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,0462	12,7731%	0,0059%	2,0151%	2,50%	81.708.518,03	254
4	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,0434	12,1441%	0,0036%	1,3171%	2,00%	95.116.385,78	254
5	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	0,0247	11,8972%	0,0028%	1,7768%	1,50%	2.074.768.243,79	254
6	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	0,0245	11,8880%	0,0027%	1,7678%	0,30%	16.238.958,14	254
7	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,0242	12,0505%	0,0033%	2,1864%	2,00%	1.421.918.703,66	254
8	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	0,0155	11,7836%	0,0024%	2,4856%	1,90%	429.799.643,76	254
9	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0071	11,2533%	0,0005%	1,0094%	1,75%	2.115.243.246,62	254
10	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0016	11,0978%	-0,0001%	0,9829%	2,00%	83.435.794,57	254
11	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,0151	11,0268%	-0,0004%	0,3865%	0,70%	112.937.895,95	254
12	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,0269	10,8821%	-0,0009%	0,5161%	0,50%	551.934.312,66	254
13	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,0394	10,6270%	-0,0018%	0,7156%	1,00%	57.755.173,25	254
14	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,0430	9,8047%	-0,0047%	1,7229%	1,50%	68.920.669,95	254
15	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,0451	9,5977%	-0,0054%	1,9009%	0,08%	116.134.279,55	254
16	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,0451	9,5595%	-0,0055%	1,9466%	0,14%	100.826.768,51	254
17	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,0482	10,9777%	-0,0005%	0,1815%	0,35%	103.490.323,32	254
18	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	-0,0663	8,2660%	-0,0102%	2,4397%	2,00%	132.495.514,17	254
19	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,0676	9,6975%	-0,0051%	1,1920%	2,00%	107.405.660,18	254
20	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,0782	8,0558%	-0,0110%	2,2235%	0,50%	141.429.778,45	254
21	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,0862	7,7420%	-0,0121%	2,2272%	2,50%	115.908.327,49	254
22	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	-0,0869	9,3757%	-0,0062%	1,1394%	1,00%	305.363.082,63	254
23	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,0873	10,2132%	-0,0033%	0,5959%	0,90%	111.525.117,46	254
24	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	-0,0894	9,7059%	-0,0051%	0,9023%	1,00%	75.393.263,84	254
25	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,0905	7,9243%	-0,0115%	2,0051%	0,35%	50.505.267,78	254
26	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,0913	8,0797%	-0,0109%	1,8906%	1,90%	2.585.868.935,67	254
27	FOF FRG FC FI MULT	-0,1096	6,7043%	-0,0159%	2,3030%	0,00%	582.204.693,73	254
28	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,1116	8,0650%	-0,0110%	1,5617%	0,96%	841.929.816,67	254
29	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,1151	6,7617%	-0,0157%	2,1658%	2,00%	637.273.347,42	254
30	SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,1228	6,1544%	-0,0179%	2,3105%	2,00%	60.057.882,38	254
31	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,1229	6,7894%	-0,0156%	2,0217%	2,00%	108.782.722,87	254
32	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1386	7,8931%	-0,0116%	1,3315%	1,50%	158.621.820,66	254
33	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1396	6,6038%	-0,0163%	1,8549%	1,00%	110.694.257,06	254
34	MAG STRATEGY FI MULT	-0,1753	7,7275%	-0,0122%	1,1105%	0,85%	98.944.557,61	254

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: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	BB MULT MACRO LP FC		-0,1781	3,6762%	-0,0272%	2,4289%	1,50%	745.716.507,03	254
36	AZ QUEST MULT FC FI MULT		-0,1798	5,6517%	-0,0199%	1,7536%	2,50%	75.599.268,08	254
37	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		-0,2223	9,7812%	-0,0048%	0,3488%	0,70%	824.082.595,85	254
38	VINCI MULTIESTRATEGIA FI MULT		-0,2286	9,3208%	-0,0065%	0,4539%	1,00%	111.404.508,30	254
39	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC		-0,2363	8,3599%	-0,0099%	0,6712%	1,00%	8.704.458.871,08	254
MÉDIA:			-0,0709	9,4382%	-0,0061%	1,5535%		626.428.782,41	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: 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	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,1408	4,1897%	0,0190%	2,1384%	2,50%	81.708.518,03	63
2	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	0,1353	4,4888%	0,0236%	2,7733%	2,00%	132.495.514,17	63
3	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,1003	3,3079%	0,0054%	0,8519%	2,00%	83.435.794,57	63
4	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	0,0459	3,2019%	0,0038%	1,3149%	2,00%	108.782.722,87	63
5	ITAU HEDGE MULT FI	0,0274	3,2427%	0,0045%	2,6169%	2,00%	252.918.915,49	63
6	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	-0,0043	2,9339%	-0,0003%	1,2998%	1,00%	75.393.263,84	63
7	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	-0,0065	2,9424%	-0,0002%	0,5944%	1,75%	2.115.243.246,62	63
8	SIC SCHRODERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,0170	2,9217%	-0,0006%	0,5307%	0,70%	112.937.895,95	63
9	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	-0,0192	2,7636%	-0,0029%	2,3999%	1,90%	429.799.643,76	63
10	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,0199	2,7321%	-0,0034%	2,6757%	1,50%	68.920.669,95	63
11	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	-0,0220	2,7618%	-0,0030%	2,1256%	2,50%	61.908.884,54	63
12	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,0427	2,6780%	-0,0043%	1,5908%	1,50%	158.621.820,66	63
13	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	-0,0519	2,7035%	-0,0039%	1,1928%	2,00%	95.116.385,78	63
14	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,0537	2,7898%	-0,0026%	0,7617%	0,50%	551.934.312,66	63
15	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,0631	2,5602%	-0,0061%	1,5357%	0,96%	841.929.816,67	63
16	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,0670	2,2549%	-0,0108%	2,5449%	2,50%	115.908.327,49	63
17	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,0712	2,4476%	-0,0078%	1,7422%	1,50%	2.074.768.243,79	63
18	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,0714	2,4489%	-0,0078%	1,7331%	0,30%	16.238.958,14	63
19	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,0784	2,3143%	-0,0099%	1,9967%	2,00%	1.421.918.703,66	63
20	FOF FRG FC FI MULT	-0,0840	2,0572%	-0,0138%	2,6067%	0,00%	582.204.693,73	63
21	MAG STRATEGY FI MULT	-0,1003	2,4819%	-0,0073%	1,1667%	0,85%	98.944.557,61	63
22	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,1024	1,6579%	-0,0200%	3,1002%	0,35%	50.505.267,78	63
23	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,1108	2,7278%	-0,0036%	0,5113%	1,00%	57.755.173,25	63
24	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,1138	2,0329%	-0,0143%	1,9880%	0,08%	116.134.279,55	63
25	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,1167	2,0471%	-0,0141%	1,9095%	0,14%	100.826.768,51	63
26	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,1183	1,9983%	-0,0148%	1,9861%	0,50%	141.429.778,45	63
27	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,1317	2,1874%	-0,0119%	1,4314%	2,00%	107.405.660,18	63
28	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1377	2,4188%	-0,0083%	0,9519%	2,50%	75.599.268,08	63
29	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,1498	2,8200%	-0,0021%	0,2276%	0,35%	103.490.323,32	63
30	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1559	2,3466%	-0,0094%	0,9640%	1,00%	110.694.257,06	63
31	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,1623	1,6106%	-0,0208%	2,0419%	2,00%	637.273.347,42	63
32	BB MULT MACRO LP FC	-0,1778	2,2695%	-0,0106%	0,9524%	1,50%	745.716.507,03	63
33	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	-0,1819	1,8867%	-0,0166%	1,4546%	1,00%	305.363.082,63	63
34	SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,1819	-0,0737%	-0,0471%	4,1049%	2,00%	60.057.882,38	63

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:02/12/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: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		MAG MULT FIF RESP LIM	-0,2393	2,8443%	-0,0018%	0,1269%	0,90%	111.525.117,46	63
36		ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,2394	1,2772%	-0,0261%	1,7314%	1,90%	2.585.868.935,67	63
37		BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,3380	2,5661%	-0,0061%	0,2901%	1,00%	8.704.458.871,08	63
38		CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,3849	2,7684%	-0,0029%	0,1259%	0,70%	824.082.595,85	63
39		VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,6096	2,7192%	-0,0037%	0,1038%	1,00%	111.404.508,30	63
MÉDIA:			-0,1019	2,5212%	-0,0067%	1,5435%		626.428.782,41	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: 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	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	0,4626	1,4786%	0,0244%	0,8373%	2,00%	108.782.722,87	20
2	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	0,3935	1,0734%	0,0044%	0,1763%	0,70%	112.937.895,95	20
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,3138	1,7290%	0,0368%	1,8603%	2,50%	81.708.518,03	20
4	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	0,3034	2,0587%	0,0531%	2,7769%	2,00%	132.495.514,17	20
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,1691	1,1349%	0,0074%	0,6952%	2,00%	83.435.794,57	20
6	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	0,1456	1,4020%	0,0207%	2,2566%	1,90%	429.799.643,76	20
7	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	0,0804	1,0514%	0,0033%	0,6476%	1,00%	305.363.082,63	20
8	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	0,0529	1,0794%	0,0047%	1,4093%	1,00%	75.393.263,84	20
9	ITAU HEDGE MULT FI	0,0231	1,0486%	0,0032%	2,2129%	2,00%	252.918.915,49	20
10	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0764	0,7935%	-0,0094%	1,9605%	2,00%	637.273.347,42	20
11	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,0834	0,8124%	-0,0085%	1,6216%	0,96%	841.929.816,67	20
12	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	-0,0858	0,9025%	-0,0041%	0,7576%	1,75%	2.115.243.246,62	20
13	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	-0,0968	0,7282%	-0,0127%	2,0773%	2,50%	61.908.884,54	20
14	MAG STRATEGY FI MULT	-0,1114	0,7780%	-0,0102%	1,4605%	0,85%	98.944.557,61	20
15	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	-0,1192	0,8039%	-0,0090%	1,1943%	2,00%	95.116.385,78	20
16	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,1237	0,8814%	-0,0051%	0,6600%	1,00%	57.755.173,25	20
17	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1581	0,8310%	-0,0076%	0,7675%	1,00%	110.694.257,06	20
18	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1588	0,7777%	-0,0103%	1,0270%	1,50%	158.621.820,66	20
19	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,1746	0,6699%	-0,0156%	1,4193%	0,50%	141.429.778,45	20
20	BB MULT MACRO LP FC	-0,1868	0,7925%	-0,0095%	0,8119%	1,50%	745.716.507,03	20
21	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,2074	0,6023%	-0,0190%	1,4513%	2,00%	107.405.660,18	20
22	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,2217	0,9707%	-0,0007%	0,0522%	0,90%	111.525.117,46	20
23	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,2455	0,8972%	-0,0044%	0,2830%	1,00%	8.704.458.871,08	20
24	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,2461	0,5286%	-0,0226%	1,4600%	1,50%	2.074.768.243,79	20
25	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,2463	0,5306%	-0,0225%	1,4524%	0,30%	16.238.958,14	20
26	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,2514	0,4979%	-0,0242%	1,5254%	0,08%	116.134.279,55	20
27	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,2527	0,4006%	-0,0290%	1,8212%	2,00%	1.421.918.703,66	20
28	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,2691	-0,2270%	-0,0602%	3,5491%	0,35%	50.505.267,78	20
29	FOF FRG FC FI MULT	-0,2710	0,2150%	-0,0382%	2,2386%	0,00%	582.204.693,73	20
30	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,2715	0,5580%	-0,0212%	1,2390%	1,90%	2.585.868.935,67	20
31	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,2757	0,9306%	-0,0027%	0,1567%	0,35%	103.490.323,32	20
32	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,2920	0,4136%	-0,0284%	1,5421%	0,14%	100.826.768,51	20
33	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,2950	0,0284%	-0,0475%	2,5559%	2,50%	115.908.327,49	20
34	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,3896	0,7315%	-0,0126%	0,5131%	0,50%	551.934.312,66	20

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: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		SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,3906	-0,8499%	-0,0914%	3,7168%	2,00%	60.057.882,38	20
36		XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,4813	0,3157%	-0,0333%	1,0969%	1,50%	68.920.669,95	20
37		AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,5038	0,3935%	-0,0294%	0,9259%	2,50%	75.599.268,08	20
38		CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,5517	0,9275%	-0,0029%	0,0827%	0,70%	824.082.595,85	20
39		VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,7837	0,9062%	-0,0039%	0,0801%	1,00%	111.404.508,30	20
MÉDIA:			-0,1507	0,7589%	-0,0112%	1,3429%		626.428.782,41	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: 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	ITAU HEDGE MULT FI	14,3061%	0,0741	0,0112%	2,4000%	2,00%	252.918.915,49	254
2	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	13,8728%	0,0657	0,0097%	2,3434%	2,50%	61.908.884,54	254
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	12,7731%	0,0462	0,0059%	2,0151%	2,50%	81.708.518,03	254
4	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	12,1441%	0,0434	0,0036%	1,3171%	2,00%	95.116.385,78	254
5	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	12,0505%	0,0242	0,0033%	2,1864%	2,00%	1.421.918.703,66	254
6	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	11,8972%	0,0247	0,0028%	1,7768%	1,50%	2.074.768.243,79	254
7	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	11,8880%	0,0245	0,0027%	1,7678%	0,30%	16.238.958,14	254
8	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	11,7836%	0,0155	0,0024%	2,4856%	1,90%	429.799.643,76	254
9	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	11,2533%	0,0071	0,0005%	1,0094%	1,75%	2.115.243.246,62	254
10	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	11,0978%	-0,0016	-0,0001%	0,9829%	2,00%	83.435.794,57	254
11	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	11,0268%	-0,0151	-0,0004%	0,3865%	0,70%	112.937.895,95	254
12	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	10,9777%	-0,0482	-0,0005%	0,1815%	0,35%	103.490.323,32	254
13	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	10,8821%	-0,0269	-0,0009%	0,5161%	0,50%	551.934.312,66	254
14	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	10,6270%	-0,0394	-0,0018%	0,7156%	1,00%	57.755.173,25	254
15	MAG MULT FIF RESP LIM	10,2132%	-0,0873	-0,0033%	0,5959%	0,90%	111.525.117,46	254
16	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	9,8047%	-0,0430	-0,0047%	1,7229%	1,50%	68.920.669,95	254
17	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	9,7812%	-0,2223	-0,0048%	0,3488%	0,70%	824.082.595,85	254
18	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	9,7059%	-0,0894	-0,0051%	0,9023%	1,00%	75.393.263,84	254
19	OCCAM INST FC FI MULT II	9,6975%	-0,0676	-0,0051%	1,1920%	2,00%	107.405.660,18	254
20	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	9,5977%	-0,0451	-0,0054%	1,9009%	0,08%	116.134.279,55	254
21	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	9,5595%	-0,0451	-0,0055%	1,9466%	0,14%	100.826.768,51	254
22	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	9,3757%	-0,0869	-0,0062%	1,1394%	1,00%	305.363.082,63	254
23	VINCI MULTIESTRATEGIA FI MULT	9,3208%	-0,2286	-0,0065%	0,4539%	1,00%	111.404.508,30	254
24	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	8,3599%	-0,2363	-0,0099%	0,6712%	1,00%	8.704.458.871,08	254
25	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	8,2660%	-0,0663	-0,0102%	2,4397%	2,00%	132.495.514,17	254
26	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	8,0797%	-0,0913	-0,0109%	1,8906%	1,90%	2.585.868.935,67	254
27	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	8,0650%	-0,1116	-0,0110%	1,5617%	0,96%	841.929.816,67	254
28	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	8,0558%	-0,0782	-0,0110%	2,2235%	0,50%	141.429.778,45	254
29	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	7,9243%	-0,0905	-0,0115%	2,0051%	0,35%	50.505.267,78	254
30	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	7,8931%	-0,1386	-0,0116%	1,3315%	1,50%	158.621.820,66	254
31	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	7,7420%	-0,0862	-0,0121%	2,2272%	2,50%	115.908.327,49	254
32	MAG STRATEGY FI MULT	7,7275%	-0,1753	-0,0122%	1,1105%	0,85%	98.944.557,61	254
33	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	6,7894%	-0,1229	-0,0156%	2,0217%	2,00%	108.782.722,87	254
34	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	6,7617%	-0,1151	-0,0157%	2,1658%	2,00%	637.273.347,42	254

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: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		FOF FRG FC FI MULT	6,7043%	-0,1096	-0,0159%	2,3030%	0,00%	582.204.693,73	254
36		BB MULT LP EMPRESA FC	6,6038%	-0,1396	-0,0163%	1,8549%	1,00%	110.694.257,06	254
37		SAFRA FERMAT FC FI MULT	6,1544%	-0,1228	-0,0179%	2,3105%	2,00%	60.057.882,38	254
38		AZ QUEST MULT FC FI MULT	5,6517%	-0,1798	-0,0199%	1,7536%	2,50%	75.599.268,08	254
39		BB MULT MACRO LP FC	3,6762%	-0,1781	-0,0272%	2,4289%	1,50%	745.716.507,03	254
MÉDIA:			9,4382%	-0,0709	-0,0061%	1,5535%		626.428.782,41	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: 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	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	4,4888%	0,1353	0,0236%	2,7733%	2,00%	132.495.514,17	63
2	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	4,1897%	0,1408	0,0190%	2,1384%	2,50%	81.708.518,03	63
3	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	3,3079%	0,1003	0,0054%	0,8519%	2,00%	83.435.794,57	63
4	ITAU HEDGE MULT FI	3,2427%	0,0274	0,0045%	2,6169%	2,00%	252.918.915,49	63
5	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	3,2019%	0,0459	0,0038%	1,3149%	2,00%	108.782.722,87	63
6	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	2,9424%	-0,0065	-0,0002%	0,5944%	1,75%	2.115.243.246,62	63
7	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	2,9339%	-0,0043	-0,0003%	1,2998%	1,00%	75.393.263,84	63
8	SIC SCHRODERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	2,9217%	-0,0170	-0,0006%	0,5307%	0,70%	112.937.895,95	63
9	MAG MULT FIF RESP LIM	2,8443%	-0,2393	-0,0018%	0,1269%	0,90%	111.525.117,46	63
10	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	2,8200%	-0,1498	-0,0021%	0,2276%	0,35%	103.490.323,32	63
11	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	2,7898%	-0,0537	-0,0026%	0,7617%	0,50%	551.934.312,66	63
12	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	2,7684%	-0,3849	-0,0029%	0,1259%	0,70%	824.082.595,85	63
13	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	2,7636%	-0,0192	-0,0029%	2,3999%	1,90%	429.799.643,76	63
14	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	2,7618%	-0,0220	-0,0030%	2,1256%	2,50%	61.908.884,54	63
15	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	2,7321%	-0,0199	-0,0034%	2,6757%	1,50%	68.920.669,95	63
16	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	2,7278%	-0,1108	-0,0036%	0,5113%	1,00%	57.755.173,25	63
17	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	2,7192%	-0,6096	-0,0037%	0,1038%	1,00%	111.404.508,30	63
18	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	2,7035%	-0,0519	-0,0039%	1,1928%	2,00%	95.116.385,78	63
19	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	2,6780%	-0,0427	-0,0043%	1,5908%	1,50%	158.621.820,66	63
20	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	2,5661%	-0,3380	-0,0061%	0,2901%	1,00%	8.704.458.871,08	63
21	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	2,5602%	-0,0631	-0,0061%	1,5357%	0,96%	841.929.816,67	63
22	MAG STRATEGY FI MULT	2,4819%	-0,1003	-0,0073%	1,1667%	0,85%	98.944.557,61	63
23	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	2,4489%	-0,0714	-0,0078%	1,7331%	0,30%	16.238.958,14	63
24	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	2,4476%	-0,0712	-0,0078%	1,7422%	1,50%	2.074.768.243,79	63
25	AZ QUEST MULT FC FI MULT	2,4188%	-0,1377	-0,0083%	0,9519%	2,50%	75.599.268,08	63
26	BB MULT LP EMPRESA FC	2,3466%	-0,1559	-0,0094%	0,9640%	1,00%	110.694.257,06	63
27	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	2,3143%	-0,0784	-0,0099%	1,9967%	2,00%	1.421.918.703,66	63
28	BB MULT MACRO LP FC	2,2695%	-0,1778	-0,0106%	0,9524%	1,50%	745.716.507,03	63
29	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	2,2549%	-0,0670	-0,0108%	2,5449%	2,50%	115.908.327,49	63
30	OCCAM INST FC FI MULT II	2,1874%	-0,1317	-0,0119%	1,4314%	2,00%	107.405.660,18	63
31	FOF FRG FC FI MULT	2,0572%	-0,0840	-0,0138%	2,6067%	0,00%	582.204.693,73	63
32	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	2,0471%	-0,1167	-0,0141%	1,9095%	0,14%	100.826.768,51	63
33	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	2,0329%	-0,1138	-0,0143%	1,9880%	0,08%	116.134.279,55	63
34	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	1,9983%	-0,1183	-0,0148%	1,9861%	0,50%	141.429.778,45	63

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:02/12/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: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		ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	1,8867%	-0,1819	-0,0166%	1,4546%	1,00%	305.363.082,63	63
36		ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	1,6579%	-0,1024	-0,0200%	3,1002%	0,35%	50.505.267,78	63
37		OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	1,6106%	-0,1623	-0,0208%	2,0419%	2,00%	637.273.347,42	63
38		ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	1,2772%	-0,2394	-0,0261%	1,7314%	1,90%	2.585.868.935,67	63
39		SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,0737%	-0,1819	-0,0471%	4,1049%	2,00%	60.057.882,38	63
		MÉDIA:	2,5212%	-0,1019	-0,0067%	1,5435%		626.428.782,41	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/02/2025 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: 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	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	2,0587%	0,3034	0,0531%	2,7769%	2,00%	132.495.514,17	20
2	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	1,7290%	0,3138	0,0368%	1,8603%	2,50%	81.708.518,03	20
3	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	1,4786%	0,4626	0,0244%	0,8373%	2,00%	108.782.722,87	20
4	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	1,4020%	0,1456	0,0207%	2,2566%	1,90%	429.799.643,76	20
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	1,1349%	0,1691	0,0074%	0,6952%	2,00%	83.435.794,57	20
6	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	1,0794%	0,0529	0,0047%	1,4093%	1,00%	75.393.263,84	20
7	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	1,0734%	0,3935	0,0044%	0,1763%	0,70%	112.937.895,95	20
8	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	1,0514%	0,0804	0,0033%	0,6476%	1,00%	305.363.082,63	20
9	ITAU HEDGE MULT FI	1,0486%	0,0231	0,0032%	2,2129%	2,00%	252.918.915,49	20
10	MAG MULT FIF RESP LIM	0,9707%	-0,2217	-0,0007%	0,0522%	0,90%	111.525.117,46	20
11	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	0,9306%	-0,2757	-0,0027%	0,1567%	0,35%	103.490.323,32	20
12	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,9275%	-0,5517	-0,0029%	0,0827%	0,70%	824.082.595,85	20
13	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	0,9062%	-0,7837	-0,0039%	0,0801%	1,00%	111.404.508,30	20
14	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,9025%	-0,0858	-0,0041%	0,7576%	1,75%	2.115.243.246,62	20
15	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	0,8972%	-0,2455	-0,0044%	0,2830%	1,00%	8.704.458.871,08	20
16	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,8814%	-0,1237	-0,0051%	0,6600%	1,00%	57.755.173,25	20
17	BB MULT LP EMPRESA FC	0,8310%	-0,1581	-0,0076%	0,7675%	1,00%	110.694.257,06	20
18	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,8124%	-0,0834	-0,0085%	1,6216%	0,96%	841.929.816,67	20
19	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,8039%	-0,1192	-0,0090%	1,1943%	2,00%	95.116.385,78	20
20	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	0,7935%	-0,0764	-0,0094%	1,9605%	2,00%	637.273.347,42	20
21	BB MULT MACRO LP FC	0,7925%	-0,1868	-0,0095%	0,8119%	1,50%	745.716.507,03	20
22	MAG STRATEGY FI MULT	0,7780%	-0,1114	-0,0102%	1,4605%	0,85%	98.944.557,61	20
23	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	0,7777%	-0,1588	-0,0103%	1,0270%	1,50%	158.621.820,66	20
24	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	0,7315%	-0,3896	-0,0126%	0,5131%	0,50%	551.934.312,66	20
25	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,7282%	-0,0968	-0,0127%	2,0773%	2,50%	61.908.884,54	20
26	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	0,6699%	-0,1746	-0,0156%	1,4193%	0,50%	141.429.778,45	20
27	OCCAM INST FC FI MULT II	0,6023%	-0,2074	-0,0190%	1,4513%	2,00%	107.405.660,18	20
28	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	0,5580%	-0,2715	-0,0212%	1,2390%	1,90%	2.585.868.935,67	20
29	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	0,5306%	-0,2463	-0,0225%	1,4524%	0,30%	16.238.958,14	20
30	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	0,5286%	-0,2461	-0,0226%	1,4600%	1,50%	2.074.768.243,79	20
31	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	0,4979%	-0,2514	-0,0242%	1,5254%	0,08%	116.134.279,55	20
32	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	0,4136%	-0,2920	-0,0284%	1,5421%	0,14%	100.826.768,51	20
33	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,4006%	-0,2527	-0,0290%	1,8212%	2,00%	1.421.918.703,66	20
34	AZ QUEST MULT FC FI MULT	0,3935%	-0,5038	-0,0294%	0,9259%	2,50%	75.599.268,08	20

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:

03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO:

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		XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	0,3157%	-0,4813	-0,0333%	1,0969%	1,50%	68.920.669,95	20
36		FOF FRG FC FI MULT	0,2150%	-0,2710	-0,0382%	2,2386%	0,00%	582.204.693,73	20
37		OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	0,0284%	-0,2950	-0,0475%	2,5559%	2,50%	115.908.327,49	20
38		ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,2270%	-0,2691	-0,0602%	3,5491%	0,35%	50.505.267,78	20
39		SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,8499%	-0,3906	-0,0914%	3,7168%	2,00%	60.057.882,38	20
		MÉDIA:	0,7589%	-0,1507	-0,0112%	1,3429%		626.428.782,41	

ReckittPREV

*Agrupamento: Invest. no Exterior
GLOBAL (Ações, com exposição cambial)*

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 4,46539
PATRIMÔNIO: 10.401.642,72

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: EXTERIOR - AÇÕES (GLOBAL - BRL)
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	56,50%
DÓLAR PTAX	43,49%		

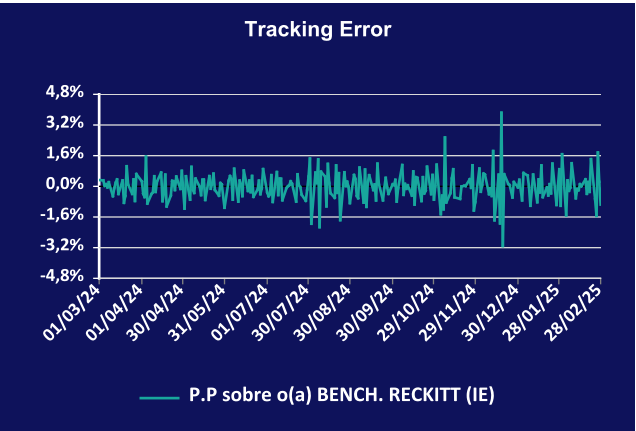
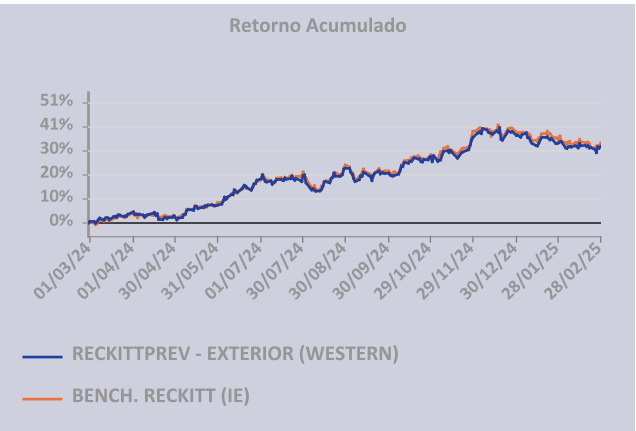
ESTILO: 24,88% | SELEÇÃO: 75,12%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0727%	17° de 36
RETORNO ACUMULADO	32,3690%	17° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	33,8317%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,4627%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0192%	23° de 36
BETA	0,6128	15° de 36
MARKET TIMING	5,8702	15° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,3811	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	28,4761%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	86,9608%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,0873	17° de 36
JENSEN	7,1876%	20° de 36
MODIGLIANI	-1,6821%	17° de 36
SHARPE	0,0825	17° de 36
SORTINO	0,1201	17° de 36
TREYNOR	0,0011	17° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,0095	--
DOWNSIDE RISK	0,6058%	21° de 36
RISCO ATIVO	0,7713%	22° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	12,2454%	22° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,6962%	23° de 36
RISCO TOTAL	0,8807%	22° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,9822%	22° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	8
MESES NEGATIVOS	4
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	7
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	5
MAIOR RETORNO MENSAL	9,8439%(06/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,9831%(01/2025)



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	-1,48%	-3,44%	32,37%	70,86%	55,04%	2,29% (31/07/2024)	-3,41% (19/12/2024)
BENCH. RECKITT (IE)	-0,50%	-3,06%	33,83%	61,68%	66,09%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI EUROPE	3,53%	10,59%	8,30%	18,68%	14,05%	2,20% (12/06/2024)	-2,36% (19/12/2024)
MSCI WORLD	-0,81%	2,63%	14,03%	40,18%	27,69%	1,68% (15/01/2025)	-3,08% (05/08/2024)
DÓLAR D2	0,94%	-4,65%	18,69%	12,95%	14,28%	2,36% (23/12/2024)	-2,04% (03/07/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)
EURO PTAX	0,35%	-5,49%	12,77%	10,11%	5,23%	2,53% (28/11/2024)	-2,22% (06/08/2024)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,50%	-3,06%	33,83%	57,44%	45,31%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI WORLD - BRL D2	0,11%	-2,15%	35,34%	58,33%	45,92%	2,96% (23/12/2024)	-2,98% (05/08/2024)
S&P 500	-1,42%	1,24%	16,84%	49,98%	35,80%	2,53% (06/11/2024)	-3,00% (05/08/2024)
S&P 500 BRL PTAX	-1,11%	-4,38%	37,13%	68,44%	54,55%	4,43% (29/11/2024)	-3,05% (18/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 4,46539
PATRIMÔNIO: 10.401.642,72

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: EXTERIOR - AÇÕES (GLOBAL - BRL)
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	69,10%
DÓLAR PTAX	30,90%		

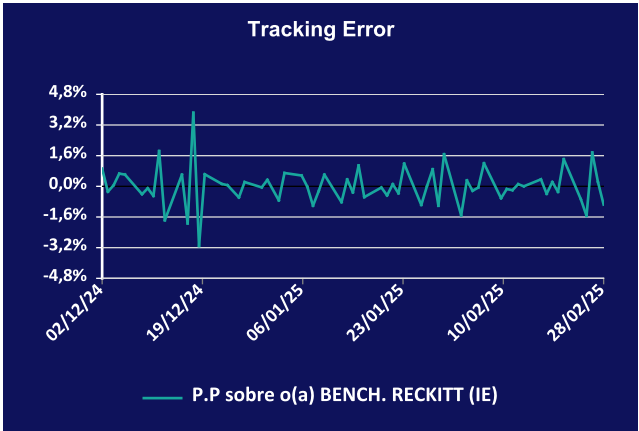
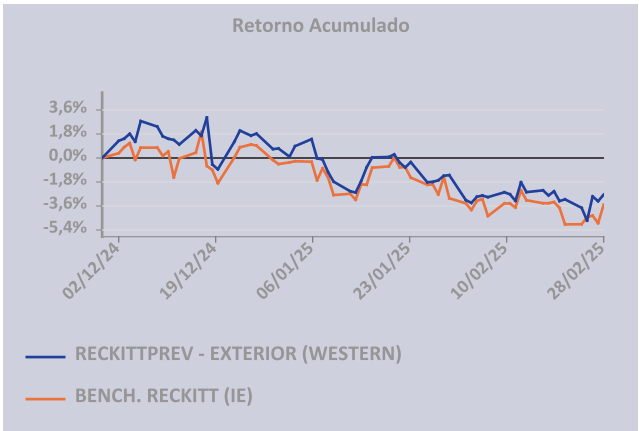
ESTILO: 30,86% | SELEÇÃO: 69,14%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0865%	23° de 36
RETORNO ACUMULADO	-2,7491%	23° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	-3,5035%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,7544%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,2540%	17° de 36
BETA	0,4457	19° de 36
MARKET TIMING	25,9309	21° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,2403	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	95,6276%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9714%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	99,4813%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,1924	23° de 36
JENSEN	-3,3508%	23° de 36
MODIGLIANI	0,7401%	26° de 36
SHARPE	-0,0957	26° de 36
SORTINO	-0,1242	23° de 36
TREYNOR	-0,0023	20° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,7561	--
DOWNSIDE RISK	0,6960%	19° de 36
RISCO ATIVO	1,0182%	21° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	16,1642%	21° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,8403%	20° de 36
RISCO TOTAL	0,9028%	22° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,3326%	22° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,7112%(12/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,9831%(01/2025)



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	-1,48%	-3,44%	32,37%	70,86%	55,04%	2,09% (23/12/2024)	-3,41% (19/12/2024)
BENCH. RECKITT (IE)	-0,50%	-3,06%	33,83%	61,68%	66,09%	1,97% (23/12/2024)	-2,50% (18/12/2024)
MSCI EUROPE	3,53%	10,59%	8,30%	18,68%	14,05%	1,99% (06/01/2025)	-2,36% (19/12/2024)
MSCI WORLD	-0,81%	2,63%	14,03%	40,18%	27,69%	1,68% (15/01/2025)	-2,40% (18/12/2024)
DÓLAR D2	0,94%	-4,65%	18,69%	12,95%	14,28%	2,36% (23/12/2024)	-1,62% (19/12/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	1,94% (17/12/2024)	-1,72% (20/12/2024)
EURO PTAX	0,35%	-5,49%	12,77%	10,11%	5,23%	1,87% (17/12/2024)	-1,67% (12/12/2024)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,50%	-3,06%	33,83%	57,44%	45,31%	1,97% (23/12/2024)	-2,50% (18/12/2024)
MSCI WORLD - BRL D2	0,11%	-2,15%	35,34%	58,33%	45,92%	2,96% (23/12/2024)	-2,27% (19/12/2024)
S&P 500	-1,42%	1,24%	16,84%	49,98%	35,80%	1,83% (15/01/2025)	-2,95% (18/12/2024)
S&P 500 BRL PTAX	-1,11%	-4,38%	37,13%	68,44%	54,55%	2,11% (23/12/2024)	-3,05% (18/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 4,46539
PATRIMÔNIO: 10.401.642,72

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: EXTERIOR - AÇÕES (GLOBAL - BRL)
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	74,31%
DÓLAR PTAX	25,69%		

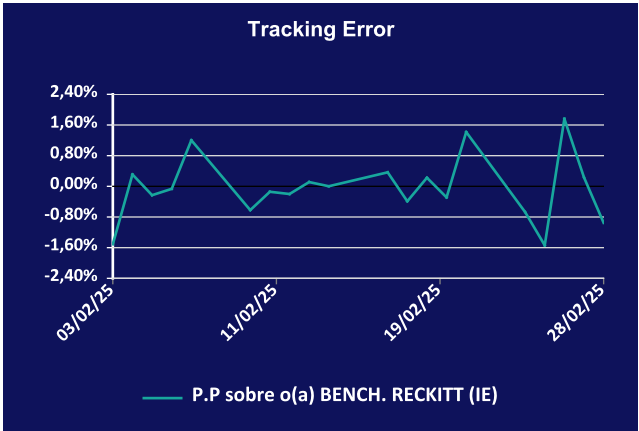
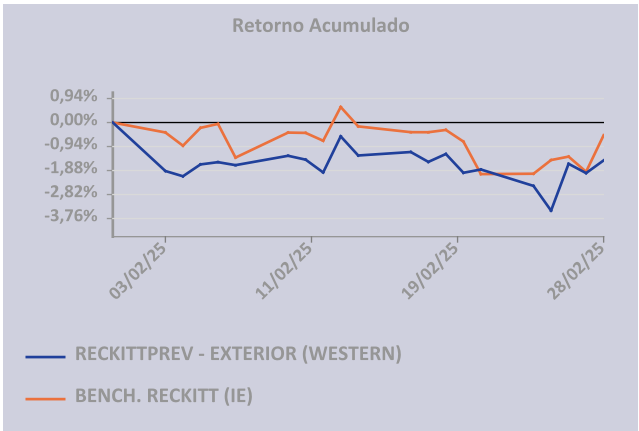
ESTILO: 37,39% | SELEÇÃO: 62,61%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1203%	21° de 36
RETORNO ACUMULADO	-1,4820%	22° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	-0,4964%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,9856%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,2546%	21° de 36
BETA	0,4574	16° de 36
MARKET TIMING	30,5255	22° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,2539	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	73,8257%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	93,5643%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	76,0664%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,9228	22° de 36
JENSEN	-1,7587%	20° de 36
MODIGLIANI	-0,7593%	22° de 36
SHARPE	-0,1448	22° de 36
SORTINO	-0,1970	24° de 36
TREYNOR	-0,0025	25° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,7637	--
DOWNSIDE RISK	0,6109%	17° de 36
RISCO ATIVO	0,8458%	21° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	13,4277%	21° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,7485%	15° de 36
RISCO TOTAL	0,8310%	19° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,1930%	19° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-1,4821%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,4821%(02/2025)



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	-1,48%	-3,44%	32,37%	70,86%	55,04%	1,90% (26/02/2025)	-1,90% (03/02/2025)
BENCH. RECKITT (IE)	-0,50%	-3,06%	33,83%	61,68%	66,09%	1,46% (28/02/2025)	-1,32% (07/02/2025)
MSCI EUROPE	3,53%	10,59%	8,30%	18,68%	14,05%	1,68% (13/02/2025)	-1,62% (03/02/2025)
MSCI WORLD	-0,81%	2,63%	14,03%	40,18%	27,69%	1,20% (13/02/2025)	-1,41% (27/02/2025)
DÓLAR D2	0,94%	-4,65%	18,69%	12,95%	14,28%	1,27% (28/02/2025)	-1,16% (14/02/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	0,91% (25/02/2025)	-1,30% (04/02/2025)
EURO PTAX	0,35%	-5,49%	12,77%	10,11%	5,23%	1,19% (25/02/2025)	-0,75% (06/02/2025)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,50%	-3,06%	33,83%	57,44%	45,31%	1,46% (28/02/2025)	-1,32% (07/02/2025)
MSCI WORLD - BRL D2	0,11%	-2,15%	35,34%	58,33%	45,92%	2,29% (28/02/2025)	-1,41% (03/02/2025)
S&P 500	-1,42%	1,24%	16,84%	49,98%	35,80%	1,59% (28/02/2025)	-1,71% (21/02/2025)
S&P 500 BRL PTAX	-1,11%	-4,38%	37,13%	68,44%	54,55%	2,04% (28/02/2025)	-1,69% (21/02/2025)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	0,8362	0,5107	64,4548%	28,3156%	0,24%	29.604.182,51	254
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	0,3425	0,3660	42,2966%	19,1117%	0,20%	891.354.779,76	254
3	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,2437	0,7328	37,1757%	13,7903%	0,22%	222.150.292,02	254
4	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,1621	0,6262	36,4103%	13,2546%	0,07%	354.948.154,86	254
5	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	0,1554	0,7171	36,0474%	14,3746%	0,06%	145.148.701,27	254
6	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	0,1474	0,5234	36,5253%	14,7239%	0,20%	485.032.482,39	254
7	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,1454	0,7202	35,8826%	14,0254%	0,20%	283.533.888,38	254
8	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	0,1346	0,3758	36,4759%	17,5890%	0,08%	578.132.173,51	254
9	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	0,0955	0,7240	35,1362%	13,7678%	0,20%	35.646.835,57	254
10	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	0,0939	0,6933	35,2184%	12,8357%	0,00%	327.773.316,20	254
11	BRADESCO GLOBAL FIA IE	0,0682	0,7491	34,7467%	13,6294%	1,25%	219.008.309,16	254
12	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	0,0283	0,7294	34,1228%	14,5181%	0,40%	64.477.320,56	254
13	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,0348	0,6439	33,4709%	13,0542%	0,50%	12.982.274,06	254
14	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-0,0543	0,5799	32,8652%	14,0148%	0,70%	10.004.486,58	254
15	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-0,0609	0,5881	32,7404%	14,0952%	0,70%	54.973.998,06	254
16	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,0629	0,6437	33,0694%	13,0470%	1,00%	707.949.064,70	254
17	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-0,0874	0,6129	32,3690%	13,9822%	0,35%	10.401.642,72	254
18	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,1658	0,4122	29,5420%	16,3108%	0,08%	1.676.132.740,59	254
19	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,1687	0,2188	28,9468%	16,5371%	0,70%	3.873.293,48	254
20	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-0,1765	0,5881	31,5028%	12,4481%	0,55%	235.356.853,18	254
21	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,1959	0,2184	28,9331%	14,9420%	0,60%	83.055.824,69	254
22	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,2301	0,4339	29,6713%	13,1471%	1,00%	67.566.553,63	254
23	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-0,2556	0,4216	27,8211%	15,8100%	0,08%	97.367.917,82	254
24	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,2837	0,2892	27,7299%	13,7536%	0,08%	143.068.883,08	254
25	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-0,2937	0,3744	26,1895%	16,9183%	0,15%	526.337.651,66	254
26	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,3308	0,5508	27,5891%	14,7677%	0,15%	125.991.654,23	254
27	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-0,3481	0,6584	27,4301%	15,4212%	0,70%	4.629.920,62	254
28	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,3641	0,2352	22,9540%	18,5313%	0,70%	59.585.687,24	254
29	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,4411	0,4400	25,3995%	13,8751%	0,50%	8.104.220,11	254
30	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-0,4496	0,4403	23,0643%	16,8637%	0,30%	293.443.003,31	254
31	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-0,6942	0,5227	17,4515%	18,0598%	0,60%	43.646.762,63	254
32	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-0,8307	0,5435	19,9745%	13,5275%	0,00%	21.280.723,21	254
33	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-0,8476	0,8555	21,8242%	15,8579%	0,75%	2.578.885,83	254
34	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-0,8995	0,2525	15,6053%	13,1574%	0,30%	6.131.835,70	254

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 01/03/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-1,0071	0,6452	19,5946%	13,4247%	1,75%	37.666.799,50	254
36		MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-1,0329	1,0063	17,4943%	18,3335%	0,20%	10.563.174,94	254
MÉDIA:			-0,1906	0,5457	30,4924%	15,2727%		218.875.119,10	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	1,1137	0,6846	-0,4850%	13,5252%	0,20%	35.646.835,57	63
2	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,8565	0,7661	-0,8742%	15,4409%	0,22%	222.150.292,02	63
3	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	0,8031	0,8987	-1,1249%	17,5896%	0,20%	10.563.174,94	63
4	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	0,7185	0,5338	-1,0931%	12,7972%	0,55%	235.356.853,18	63
5	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	0,6984	0,3792	-0,6117%	14,2514%	0,30%	6.131.835,70	63
6	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	0,6568	0,3132	0,0415%	20,6436%	0,20%	891.354.779,76	63
7	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	0,5982	0,3008	-0,7636%	15,2375%	0,08%	143.068.883,08	63
8	BRADESCO GLOBAL FIA IE	0,5877	0,7089	-1,7618%	14,5485%	1,25%	219.008.309,16	63
9	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,5618	0,6165	-1,6804%	13,8917%	0,20%	283.533.888,38	63
10	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	0,5261	0,3226	-0,8470%	18,8339%	0,08%	578.132.173,51	63
11	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	0,5178	0,5950	-1,8542%	13,5415%	1,75%	37.666.799,50	63
12	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	0,4143	0,3593	-2,0255%	12,3772%	0,00%	21.280.723,21	63
13	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	0,3957	0,6959	-2,3759%	13,4944%	0,00%	327.773.316,20	63
14	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	0,3766	0,3822	-1,9439%	14,0204%	1,00%	67.566.553,63	63
15	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,3500	0,5508	-2,3009%	13,3879%	0,07%	354.948.154,86	63
16	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	0,3399	0,5963	-2,3849%	13,3832%	0,50%	12.982.274,06	63
17	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	0,3189	0,5952	-2,4521%	13,3631%	1,00%	707.949.064,70	63
18	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	0,3053	0,4204	-2,2663%	14,6948%	0,70%	54.973.998,06	63
19	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	0,2812	0,4308	-2,3761%	14,6223%	0,70%	10.004.486,58	63
20	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	0,2731	0,5482	-2,5620%	14,1385%	0,06%	145.148.701,27	63
21	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	0,2296	0,3638	-2,5193%	15,6866%	0,20%	485.032.482,39	63
22	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	0,2250	0,2498	-2,4584%	16,8137%	0,70%	3.873.293,48	63
23	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	0,1924	0,4457	-2,7491%	14,3326%	0,35%	10.401.642,72	63
24	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	0,1281	0,4311	-3,0481%	19,3502%	0,60%	43.646.762,63	63
25	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	0,1225	0,4666	-3,0619%	17,9234%	0,08%	97.367.917,82	63
26	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	0,1181	0,3174	-3,0406%	18,1431%	0,15%	526.337.651,66	63
27	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	0,0642	0,8510	-3,3838%	15,0009%	0,75%	2.578.885,83	63
28	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,0176	0,3627	-3,7063%	17,4315%	0,08%	1.676.132.740,59	63
29	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,0219	0,4153	-3,5774%	13,9654%	0,50%	8.104.220,11	63
30	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,1037	0,1480	-3,9817%	14,0572%	0,60%	83.055.824,69	63
31	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-0,1713	0,5226	-5,9344%	32,8398%	0,24%	29.604.182,51	63
32	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-0,3160	0,8929	-4,9663%	20,1557%	0,70%	4.629.920,62	63
33	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-0,4819	0,5528	-5,2861%	14,9579%	0,40%	64.477.320,56	63
34	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-0,5876	0,5070	-6,4349%	18,5085%	0,30%	293.443.003,31	63

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/12/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,6185	0,3234	-6,4706%	16,4734%	0,15%	125.991.654,23	63
36		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,8069	0,1879	-8,0694%	18,8030%	0,70%	59.585.687,24	63
MÉDIA:			0,2402	0,4927	-2,7897%	16,0618%		218.875.119,10	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	3,6269	0,2905	3,6665%	12,2265%	0,30%	6.131.835,70	20
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	3,5586	0,8793	2,3498%	14,5765%	0,20%	35.646.835,57	20
3	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	1,9520	0,1997	1,7642%	11,4686%	0,08%	143.068.883,08	20
4	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	1,3123	0,6916	0,3836%	11,4687%	0,55%	235.356.853,18	20
5	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	1,1509	0,8636	0,3995%	14,6170%	0,22%	222.150.292,02	20
6	BRADESCO GLOBAL FIA IE	0,7940	0,8139	0,0775%	13,5864%	1,25%	219.008.309,16	20
7	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,2033	0,5708	-0,3222%	12,1192%	0,07%	354.948.154,86	20
8	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-0,0621	0,8079	-0,5546%	13,4196%	0,00%	327.773.316,20	20
9	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-0,0948	0,5437	-0,5616%	10,8847%	1,75%	37.666.799,50	20
10	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,1860	--	-0,7370%	10,9262%	0,70%	3.873.293,48	20
11	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,1883	0,3242	-0,6821%	11,2050%	1,00%	67.566.553,63	20
12	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,2249	0,6643	-0,6553%	11,6960%	0,50%	12.982.274,06	20
13	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,2523	0,6634	-0,6746%	11,6761%	1,00%	707.949.064,70	20
14	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-0,2658	0,7537	-0,6891%	12,6244%	0,20%	283.533.888,38	20
15	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,4638	0,0035	-1,1662%	13,6535%	0,08%	1.676.132.740,59	20
16	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,4703	--	-1,1019%	8,5241%	0,60%	83.055.824,69	20
17	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-0,7093	0,4190	-1,2779%	13,1584%	0,70%	10.004.486,58	20
18	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-0,7145	--	-1,9789%	21,2295%	0,20%	891.354.779,76	20
19	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-0,7541	0,4083	-1,3441%	13,3382%	0,70%	54.973.998,06	20
20	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-0,8847	0,4057	-1,5319%	13,8907%	0,20%	485.032.482,39	20
21	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-0,9140	--	-1,9383%	15,5059%	0,08%	578.132.173,51	20
22	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-0,9229	0,4574	-1,4821%	13,1931%	0,35%	10.401.642,72	20
23	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,9451	0,9993	-1,2002%	15,1302%	0,20%	10.563.174,94	20
24	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-1,0242	0,2672	-1,6010%	11,4599%	0,50%	8.104.220,11	20
25	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-1,0968	0,2888	-1,8298%	13,3508%	0,15%	125.991.654,23	20
26	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-1,1102	0,7597	-1,2119%	11,9834%	0,40%	64.477.320,56	20
27	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-1,3649	0,6897	-1,4772%	11,6080%	0,00%	21.280.723,21	20
28	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-1,4048	0,1260	-2,4719%	14,6966%	0,30%	293.443.003,31	20
29	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-1,6915	0,4174	-2,3284%	12,8890%	0,06%	145.148.701,27	20
30	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-2,0419	0,8458	-1,6955%	12,5490%	0,75%	2.578.885,83	20
31	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-2,0642	0,1266	-3,3060%	14,1494%	0,08%	97.367.917,82	20
32	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-2,3696	--	-8,1533%	37,3162%	0,24%	29.604.182,51	20
33	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-2,3737	0,4402	-3,4417%	15,3662%	0,60%	43.646.762,63	20
34	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-2,6716	0,0808	-4,0590%	13,3973%	0,15%	526.337.651,66	20

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 03/02/2025 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-2,8295	--	-4,6321%	14,0548%	0,70%	59.585.687,24	20
36		ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-3,2647	1,2867	-4,2192%	20,8399%	0,70%	4.629.920,62	20
MÉDIA:			-0,5767	0,4231	-1,3801%	13,9939%		218.875.119,10	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	64,4548%	41,3901%	0,5107	28,3156%	0,24%	29.604.182,51	254
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	42,2966%	22,6835%	0,3660	19,1117%	0,20%	891.354.779,76	254
3	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	37,1757%	9,3849%	0,7328	13,7903%	0,22%	222.150.292,02	254
4	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	36,5253%	13,3133%	0,5234	14,7239%	0,20%	485.032.482,39	254
5	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	36,4759%	16,7419%	0,3758	17,5890%	0,08%	578.132.173,51	254
6	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	36,4103%	10,9720%	0,6262	13,2546%	0,07%	354.948.154,86	254
7	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	36,0474%	8,4543%	0,7171	14,3746%	0,06%	145.148.701,27	254
8	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	35,8826%	8,3724%	0,7202	14,0254%	0,20%	283.533.888,38	254
9	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	35,2184%	8,3018%	0,6933	12,8357%	0,00%	327.773.316,20	254
10	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	35,1362%	7,3241%	0,7240	13,7678%	0,20%	35.646.835,57	254
11	BRADESCO GLOBAL FIA IE	34,7467%	6,6115%	0,7491	13,6294%	1,25%	219.008.309,16	254
12	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	34,1228%	6,4556%	0,7294	14,5181%	0,40%	64.477.320,56	254
13	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	33,4709%	7,6557%	0,6439	13,0542%	0,50%	12.982.274,06	254
14	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	33,0694%	7,2611%	0,6437	13,0470%	1,00%	707.949.064,70	254
15	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	32,8652%	8,4222%	0,5799	14,0148%	0,70%	10.004.486,58	254
16	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	32,7404%	8,1098%	0,5881	14,0952%	0,70%	54.973.998,06	254
17	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	32,3690%	7,1876%	0,6129	13,9822%	0,35%	10.401.642,72	254
18	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	31,5028%	6,8875%	0,5881	12,4481%	0,55%	235.356.853,18	254
19	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	29,6713%	8,6078%	0,4339	13,1471%	1,00%	67.566.553,63	254
20	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	29,5420%	8,9445%	0,4122	16,3108%	0,08%	1.676.132.740,59	254
21	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	28,9468%	12,6416%	0,2188	16,5371%	0,70%	3.873.293,48	254
22	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	28,9331%	12,6189%	0,2184	14,9420%	0,60%	83.055.824,69	254
23	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	27,8211%	7,0504%	0,4216	15,8100%	0,08%	97.367.917,82	254
24	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	27,7299%	9,9303%	0,2892	13,7536%	0,08%	143.068.883,08	254
25	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	27,5891%	3,6812%	0,5508	14,7677%	0,15%	125.991.654,23	254
26	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	27,4301%	1,3636%	0,6584	15,4212%	0,70%	4.629.920,62	254
27	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	26,1895%	6,4913%	0,3744	16,9183%	0,15%	526.337.651,66	254
28	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	25,3995%	4,2071%	0,4400	13,8751%	0,50%	8.104.220,11	254
29	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	23,0643%	1,8578%	0,4403	16,8637%	0,30%	293.443.003,31	254
30	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	22,9540%	6,3115%	0,2352	18,5313%	0,70%	59.585.687,24	254
31	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	21,8242%	-8,8325%	0,8555	15,8579%	0,75%	2.578.885,83	254
32	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	19,9745%	-3,1579%	0,5435	13,5275%	0,00%	21.280.723,21	254
33	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	19,5946%	-6,2057%	0,6452	13,4247%	1,75%	37.666.799,50	254
34	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	17,4943%	-16,6306%	1,0063	18,3335%	0,20%	10.563.174,94	254

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/03/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	17,4515%	-5,7858%	0,5227	18,0598%	0,60%	43.646.762,63	254
36		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	15,6053%	-1,4621%	0,2525	13,1574%	0,30%	6.131.835,70	254
MÉDIA:			30,4924%	6,8656%	0,5457	15,2727%		218.875.119,10	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	0,0415%	-1,7518%	0,3132	20,6436%	0,20%	891.354.779,76	63
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-0,4850%	0,7730%	0,6846	13,5252%	0,20%	35.646.835,57	63
3	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-0,6117%	-1,6208%	0,3792	14,2514%	0,30%	6.131.835,70	63
4	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,7636%	-2,4653%	0,3008	15,2375%	0,08%	143.068.883,08	63
5	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-0,8470%	-2,6222%	0,3226	18,8339%	0,08%	578.132.173,51	63
6	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	-0,8742%	0,5957%	0,7661	15,4409%	0,22%	222.150.292,02	63
7	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-1,0931%	-1,0829%	0,5338	12,7972%	0,55%	235.356.853,18	63
8	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-1,1249%	1,4458%	0,8987	17,5896%	0,20%	10.563.174,94	63
9	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-1,6804%	-1,1128%	0,6165	13,8917%	0,20%	283.533.888,38	63
10	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-1,7618%	-0,5077%	0,7089	14,5485%	1,25%	219.008.309,16	63
11	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-1,8542%	-1,2995%	0,5950	13,5415%	1,75%	37.666.799,50	63
12	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-1,9439%	-3,0602%	0,3822	14,0204%	1,00%	67.566.553,63	63
13	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-2,0255%	-2,4382%	0,3593	12,3772%	0,00%	21.280.723,21	63
14	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-2,2663%	-3,0544%	0,4204	14,6948%	0,70%	54.973.998,06	63
15	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-2,3009%	-2,1877%	0,5508	13,3879%	0,07%	354.948.154,86	63
16	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-2,3759%	-1,2956%	0,6959	13,4944%	0,00%	327.773.316,20	63
17	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-2,3761%	-3,0995%	0,4308	14,6223%	0,70%	10.004.486,58	63
18	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-2,3849%	-2,0165%	0,5963	13,3832%	0,50%	12.982.274,06	63
19	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-2,4521%	-2,0894%	0,5952	13,3631%	1,00%	707.949.064,70	63
20	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-2,4584%	-4,5609%	0,2498	16,8137%	0,70%	3.873.293,48	63
21	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-2,5193%	-3,7782%	0,3638	15,6866%	0,20%	485.032.482,39	63
22	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-2,5620%	-2,2743%	0,5482	14,1385%	0,06%	145.148.701,27	63
23	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-2,7491%	-3,3509%	0,4457	14,3326%	0,35%	10.401.642,72	63
24	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-3,0406%	-4,7511%	0,3174	18,1431%	0,15%	526.337.651,66	63
25	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-3,0481%	-3,9502%	0,4311	19,3502%	0,60%	43.646.762,63	63
26	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-3,0619%	-3,7501%	0,4666	17,9234%	0,08%	97.367.917,82	63
27	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-3,3838%	-0,8820%	0,8510	15,0009%	0,75%	2.578.885,83	63
28	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-3,5774%	-4,5034%	0,4153	13,9654%	0,50%	8.104.220,11	63
29	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-3,7063%	-5,1528%	0,3627	17,4315%	0,08%	1.676.132.740,59	63
30	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-3,9817%	-6,6049%	0,1480	14,0572%	0,60%	83.055.824,69	63
31	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-4,9663%	-2,4473%	0,8929	20,1557%	0,70%	4.629.920,62	63
32	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-5,2861%	-5,1686%	0,5528	14,9579%	0,40%	64.477.320,56	63
33	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-5,9344%	-6,9218%	0,5226	32,8398%	0,24%	29.604.182,51	63
34	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-6,4349%	-6,9580%	0,5070	18,5085%	0,30%	293.443.003,31	63

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/12/2024 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-6,4706%	-7,9916%	0,3234	16,4734%	0,15%	125.991.654,23	63
36		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-8,0694%	-10,6149%	0,1879	18,8030%	0,70%	59.585.687,24	63
MÉDIA:			-2,7897%	-3,1264%	0,4927	16,0618%		218.875.119,10	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 03/02/2025 A 28/02/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	3,6665%	3,1446%	0,2905	12,2265%	0,30%	6.131.835,70	20
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	2,3498%	2,6771%	0,8793	14,5765%	0,20%	35.646.835,57	20
3	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	1,7642%	1,1168%	0,1997	11,4686%	0,08%	143.068.883,08	20
4	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,3995%	0,7313%	0,8636	14,6170%	0,22%	222.150.292,02	20
5	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	0,3836%	0,4529%	0,6916	11,4687%	0,55%	235.356.853,18	20
6	BRADESCO GLOBAL FIA IE	0,0775%	0,3327%	0,8139	13,5864%	1,25%	219.008.309,16	20
7	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-0,3222%	-0,4238%	0,5708	12,1192%	0,07%	354.948.154,86	20
8	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-0,5546%	-0,3002%	0,8079	13,4196%	0,00%	327.773.316,20	20
9	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-0,5616%	-0,7080%	0,5437	10,8847%	1,75%	37.666.799,50	20
10	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,6553%	-0,6207%	0,6643	11,6960%	0,50%	12.982.274,06	20
11	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,6746%	-0,6414%	0,6634	11,6761%	1,00%	707.949.064,70	20
12	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,6821%	-1,1414%	0,3242	11,2050%	1,00%	67.566.553,63	20
13	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-0,6891%	-0,5206%	0,7537	12,6244%	0,20%	283.533.888,38	20
14	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,7370%	-1,8559%	--	10,9262%	0,70%	3.873.293,48	20
15	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-1,1019%	-2,4733%	--	8,5241%	0,60%	83.055.824,69	20
16	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-1,1662%	-2,0996%	0,0035	13,6535%	0,08%	1.676.132.740,59	20
17	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-1,2002%	-0,6845%	0,9993	15,1302%	0,20%	10.563.174,94	20
18	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-1,2119%	-1,0611%	0,7597	11,9834%	0,40%	64.477.320,56	20
19	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-1,2779%	-1,6117%	0,4190	13,1584%	0,70%	10.004.486,58	20
20	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-1,3441%	-1,6921%	0,4083	13,3382%	0,70%	54.973.998,06	20
21	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-1,4772%	-1,4600%	0,6897	11,6080%	0,00%	21.280.723,21	20
22	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-1,4821%	-1,7588%	0,4574	13,1931%	0,35%	10.401.642,72	20
23	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-1,5319%	-1,8845%	0,4057	13,8907%	0,20%	485.032.482,39	20
24	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-1,6010%	-2,1473%	0,2672	11,4599%	0,50%	8.104.220,11	20
25	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-1,6955%	-1,4135%	0,8458	12,5490%	0,75%	2.578.885,83	20
26	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-1,8298%	-2,3680%	0,2888	13,3508%	0,15%	125.991.654,23	20
27	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-1,9383%	-2,9234%	--	15,5059%	0,08%	578.132.173,51	20
28	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-1,9789%	-2,9700%	--	21,2295%	0,20%	891.354.779,76	20
29	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-2,3284%	-2,6937%	0,4174	12,8890%	0,06%	145.148.701,27	20
30	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-2,4719%	-3,2230%	0,1260	14,6966%	0,30%	293.443.003,31	20
31	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-3,3060%	-4,0676%	0,1266	14,1494%	0,08%	97.367.917,82	20
32	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-3,4417%	-3,7478%	0,4402	15,3662%	0,60%	43.646.762,63	20
33	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-4,0590%	-4,8874%	0,0808	13,3973%	0,15%	526.337.651,66	20
34	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-4,2192%	-3,2744%	1,2867	20,8399%	0,70%	4.629.920,62	20

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE: 03/02/2025 A 28/02/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, 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	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-4,6321%	-5,6780%	--	14,0548%	0,70%	59.585.687,24	20
36		GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-8,1533%	-9,4454%	--	37,3162%	0,24%	29.604.182,51	20
MÉDIA:			-1,3801%	-1,7034%	0,4231	13,9939%		218.875.119,10	

2023 | BENCH. RECKITT (TOTAL) DE 02.01.23 A 31.05.23: 68.85% SELIC + 7.65% IMA-B5 + 6.00% IBrX-100 + 14.25% CDI + 3.25% S&P 500 (R\$)
2023 | BENCH. RECKITT (TOTAL) DE 01.06.23 A 31.12.23: 78.75% SELIC + 8.75% IMA-B5 + 6.00% IBrX-100 + 3.25% CDI + 3.25% S&P 500 (R\$)
2024 | BENCH. RECKITT (TOTAL): 72.70% SELIC + 13.30% IMA-B5 + 7.00% IBrX-100 + 7.00% MSCI WORLD (R\$)
2025 | BENCH. RECKITT (TOTAL): 87.00% (SELIC + 0.50% ao ano) + 6.50% IBrX-100 + 6.50% MSCI WORLD (R\$)

ReckittPREV

Agrupamento: -.-

CONSOLIDADO (Gestão Ativa, Western)

Fevereiro/2025

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,06745
PATRIMÔNIO: 167.519.519,44

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	76,36%	IBX	5,95%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	8,69%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	7,90%	DÓLAR PTAX	1,10%

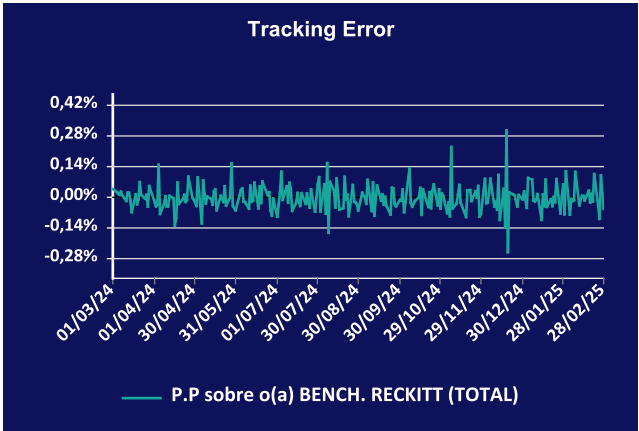
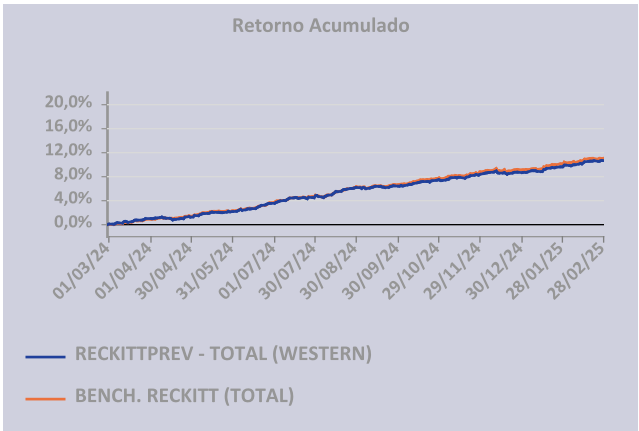
ESTILO: 47,14% | SELEÇÃO: 52,86%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0016%	--
RETORNO ACUMULADO	10,6680%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,0841%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4161%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0024%	--
BETA	0,0640	--
MARKET TIMING	-0,0689	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,4260	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	40,4982%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	17,8340%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,3885	--
JENSEN	0,5303%	--
MODIGLIANI	10,7961%	--
SHARPE	-0,0190	--
SORTINO	-0,0260	--
TREYNOR	-0,0002	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,5531	--
DOWNSIDE RISK	0,0616%	--
RISCO ATIVO	0,0605%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9611%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0639%	--
RISCO TOTAL	0,0843%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3389%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	5
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	7
MAIOR RETORNO MENSAL	1,3432%(06/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	0,2072%(09/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,67%	1,79%	10,67%	26,98%	35,50%	0,31% (31/07/2024)	-0,27% (12/12/2024)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,69%	1,77%	11,08%	26,24%	39,57%	0,32% (30/01/2025)	-0,43% (18/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,06745
PATRIMÔNIO: 167.519.519,44

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	86,84%	IBX	5,02%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	2,48%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	4,96%	DÓLAR PTAX	0,69%

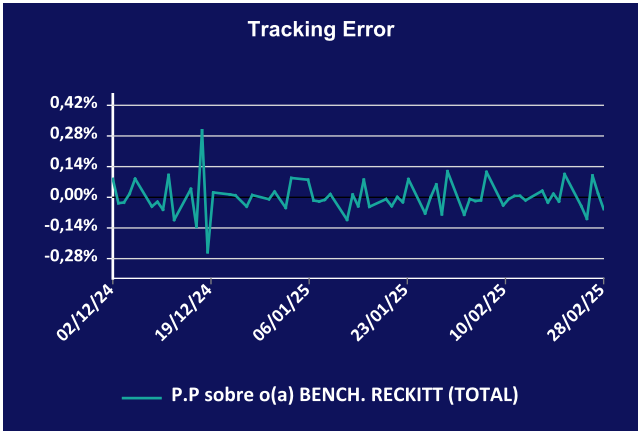
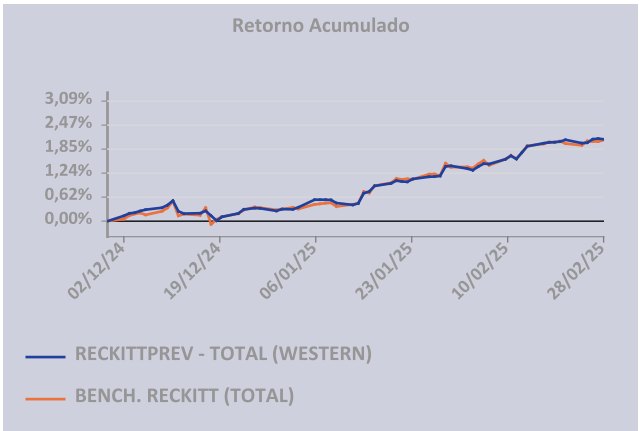
ESTILO: 50,71% | SELEÇÃO: 49,29%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0131%	--
RETORNO ACUMULADO	2,1095%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,0892%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0203%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0092%	--
BETA	0,0536	--
MARKET TIMING	0,0232	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,4955	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	68,2670%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	5,0768%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,0595	--
JENSEN	-0,5637%	--
MODIGLIANI	-5,8153%	--
SHARPE	-0,1515	--
SORTINO	-0,1898	--
TREYNOR	-0,0024	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,9256	--
DOWNSIDE RISK	0,0690%	--
RISCO ATIVO	0,0758%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,2042%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0615%	--
RISCO TOTAL	0,0864%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3722%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1119%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,3105%(12/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,67%	1,79%	10,67%	26,98%	35,50%	0,26% (15/01/2025)	-0,27% (12/12/2024)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,69%	1,77%	11,08%	26,24%	39,57%	0,32% (30/01/2025)	-0,43% (18/12/2024)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,04% (10/12/2024)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	1,94% (17/12/2024)	-1,72% (20/12/2024)

DADOS CADASTRAIS

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

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 3,06745
PATRIMÔNIO: 167.519.519,44

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	94,70%	IBX	3,95%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	1,34%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

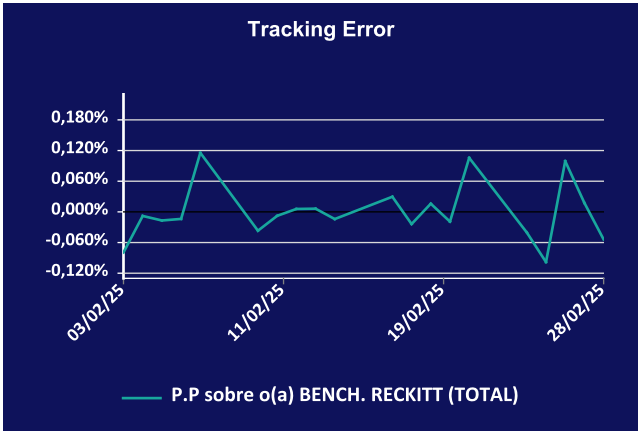
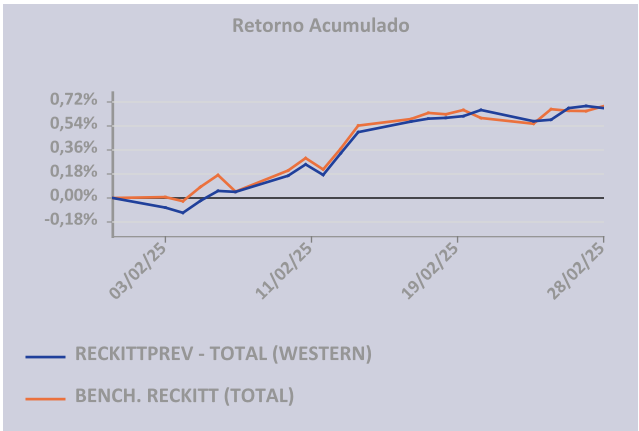
ESTILO: 53,01% | SELEÇÃO: 46,99%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0154%	--
RETORNO ACUMULADO	0,6741%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,6899%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0158%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0031%	--
BETA	0,0524	--
MARKET TIMING	-0,2744	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5321	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	16,8700%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9575%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	29,0225%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2253	--
JENSEN	-0,1224%	--
MODIGLIANI	-0,7271%	--
SHARPE	-0,2109	--
SORTINO	-0,2600	--
TREYNOR	-0,0029	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,8318	--
DOWNSIDE RISK	0,0592%	--
RISCO ATIVO	0,0559%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,8879%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0501%	--
RISCO TOTAL	0,0730%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,1599%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,6742%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,6742%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,67%	1,79%	10,67%	26,98%	35,50%	0,16% (13/02/2025)	-0,08% (24/02/2025)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,69%	1,77%	11,08%	26,24%	39,57%	0,17% (14/02/2025)	-0,12% (07/02/2025)
CDI	0,99%	2,01%	11,13%	25,28%	41,58%	0,05% (17/02/2025)	0,05% (24/02/2025)
IBOVESPA	-2,64%	2,09%	-4,82%	17,03%	8,54%	2,70% (14/02/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	-2,68%	2,10%	-4,38%	16,87%	7,25%	2,73% (14/02/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	-2,38%	1,83%	-8,67%	9,90%	-9,59%	2,51% (14/02/2025)	-1,54% (24/02/2025)
SMLL	-3,87%	2,01%	-18,55%	-2,75%	-22,41%	3,06% (14/02/2025)	-2,14% (24/02/2025)
IDIV	-2,78%	0,63%	0,64%	26,97%	33,37%	2,44% (14/02/2025)	-1,81% (12/02/2025)
IRF-M	0,61%	3,20%	3,94%	20,42%	32,61%	0,43% (17/02/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA B 5	0,65%	2,55%	7,49%	18,71%	32,45%	0,23% (14/02/2025)	-0,19% (04/02/2025)
IMA B 5+	0,41%	0,84%	-6,96%	10,03%	15,37%	1,12% (14/02/2025)	-0,93% (24/02/2025)
DÓLAR PTAX	0,32%	-5,55%	17,37%	12,31%	13,80%	0,91% (25/02/2025)	-1,30% (04/02/2025)