



Avaliação de Performance: RECKITT PREV
Plano de Benefícios

Janeiro/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 11,4%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 9,4%, 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 janeiro, a atuação da Western à frente desta carteira de renda variável, segundo os rankings elaborados pela PPS, pode ser classificada como inadequada. Nota-se que o retorno acumulado, apesar de consideravelmente positivo, não superou o IBrX-100 e ocupou apenas o 23º lugar entre 25 possibilidades. Ao mesmo tempo, o risco total e o beta situaram-se abaixo da mediana da amostra; contrapondo-se ao risco diversificável. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, se mostraram positivos e razoáveis. Neste mês, há indícios de sucesso na seleção dos ativos e de insucesso em “timing”. 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 108,3% do CDI, foi um dos maiores do agrupamento conservador. Ao mesmo tempo, o risco total ocupou o 19º lugar, de um total de 39, enquanto os índices de Sharpe e de Sortino, medidas de retorno ajustado por risco, se mostraram positivos e favoráveis. O desempenho mensal também agradou, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS.

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

- **CARTEIRA EXTERIOR (WESTERN):** O histórico dos últimos doze meses desta carteira se mostrou adequado. Nota-se que o retorno acumulado, de 40,9%, alinhou-se à variação exibida pelo “benchmark” proposto, sendo o 12º 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 e favorável. No entanto, o desempenho mensal poderia ter sido melhor, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS. Registra-se, ainda, que o histórico construído em algumas janelas de longo prazo permaneceu aquém do esperado, como, por exemplo, nos últimos trinta e seis meses. Portanto, sugere-se manter o gestor “em observação”.

CONSOLIDADO

- CARTEIRA CONSOLIDADA - (WESTERN) - Gestão Ativa: O rendimento obtido pela carteira consolidada nos últimos doze meses, de 11,0%, figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto, de 11,5. Em janeiro, temos um resultado satisfatório e capaz de atender às expectativas. 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 – JANEIRO DE 2025

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	28.982.657,49	13,77%
Renda Fixa (Ativa)	144.396.119,35	68,60%
Renda Variável	10.396.917,40	4,94%
Estruturado	16.153.252,73	7,67%
Exterior	10.558.123,86	5,02%
Total	210.487.070,83	100,00%

Fonte: PPS

ReckittPREV

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

Janeiro/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: 6,29934
PATRIMÔNIO: 28.982.657,49

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,44%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,56%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 4,36%

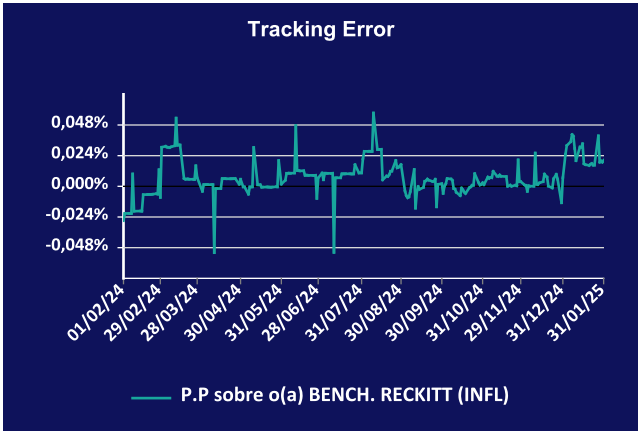
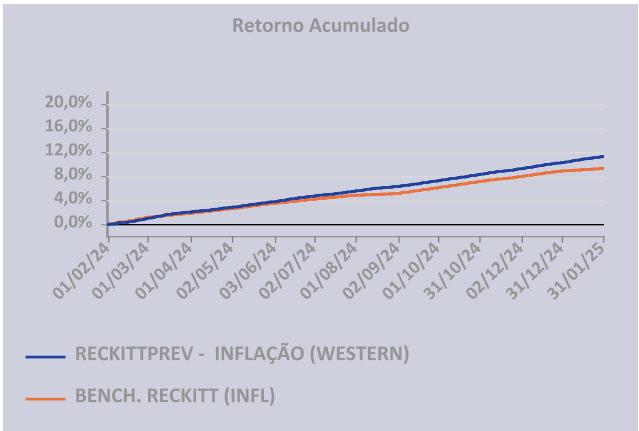
SELEÇÃO: 95,64%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0016%	--
RETORNO ACUMULADO	11,3961%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	9,3828%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	2,0133%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1540	--
SORTINO	0,2367	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,7402	--
DOWNSIDE RISK	0,0070%	--
RISCO ATIVO	0,0140%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2231%	--
RISCO TOTAL	0,0111%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1768%	--

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	1,0304%(03/2024)
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	0,96%	0,96%	11,40%	24,08%	39,85%	0,08% (12/03/2024)	-0,02% (10/07/2024)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,41%	0,41%	9,38%	19,24%	32,35%	0,06% (01/02/2024)	0,01% (01/08/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,04% (01/02/2024)	-0,00% (12/08/2024)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,04% (01/02/2024)	-0,01% (05/08/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	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: 6,29934
PATRIMÔNIO: 28.982.657,49

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,40%	IRF-M	0,21%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,09%
IMA-C	0,11%	DÓLAR PTAX	0,18%

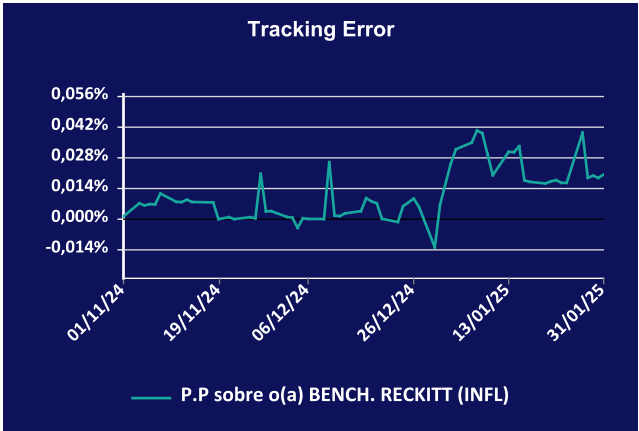
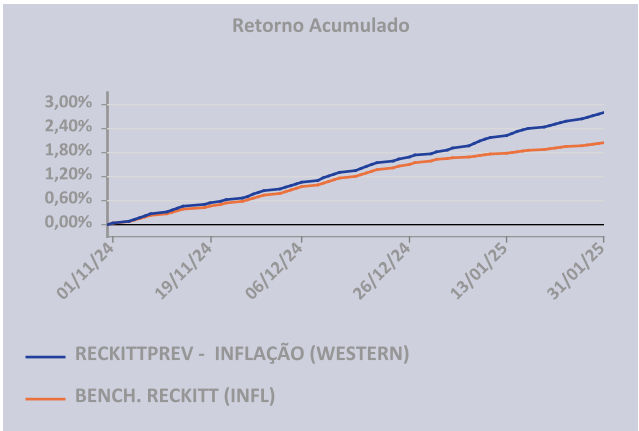
ESTILO: 12,86% | SELEÇÃO: 87,14%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0006%	--
RETORNO ACUMULADO	2,8023%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,0487%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,7536%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,0824	--
SORTINO	0,1289	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,6340	--
DOWNSIDE RISK	0,0048%	--
RISCO ATIVO	0,0122%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,1939%	--
RISCO TOTAL	0,0071%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1130%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9640%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,8502%(11/2024)



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	0,96%	0,96%	11,40%	24,08%	39,85%	0,07% (10/12/2024)	0,03% (30/12/2024)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,41%	0,41%	9,38%	19,24%	32,35%	0,04% (02/12/2024)	0,02% (02/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (01/11/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,02% (02/12/2024)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,02% (02/12/2024)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,78% (07/11/2024)

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: 6,29934
PATRIMÔNIO: 28.982.657,49

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	96,89%	IRF-M	0,64%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	2,20%	DÓLAR PTAX	0,26%

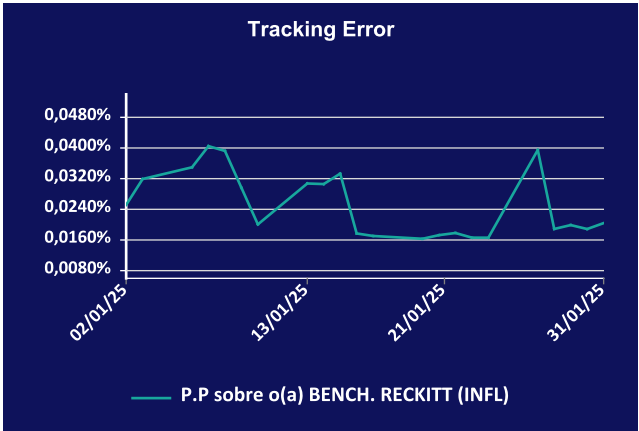
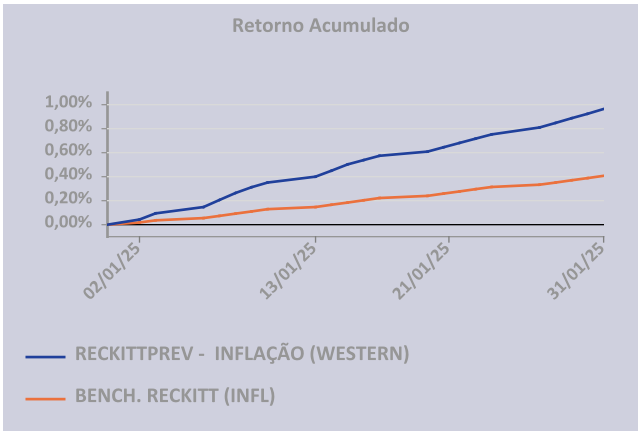
ESTILO: 13,46% | SELEÇÃO: 86,54%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0022%	--
RETORNO ACUMULADO	0,9640%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,4074%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,5566%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,2502	--
SORTINO	-0,3120	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,6076	--
DOWNSIDE RISK	0,0070%	--
RISCO ATIVO	0,0085%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,1361%	--
RISCO TOTAL	0,0085%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1361%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9640%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9640%(01/2025)



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	0,96%	0,96%	11,40%	24,08%	39,85%	0,06% (07/01/2025)	0,03% (20/01/2025)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,41%	0,41%	19,24%	32,35%	32,35%	0,02% (02/01/2025)	0,02% (02/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (07/01/2025)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,64% (30/01/2025)	-0,26% (16/01/2025)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,04% (08/01/2025)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-0,35% (17/01/2025)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,61% (30/01/2025)	-0,13% (21/01/2025)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-0,64% (17/01/2025)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,43% (30/01/2025)	-0,09% (10/01/2025)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,01% (02/01/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,00% (02/01/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	0,95% (08/01/2025)	-1,27% (22/01/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: -.-
RENTA FIXA*

Janeiro/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: 3,55996
PATRIMÔNIO: 144.396.119,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	72,42%	IRF-M	6,03%
IMA B 5	20,72%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,83%	DÓLAR PTAX	0,00%

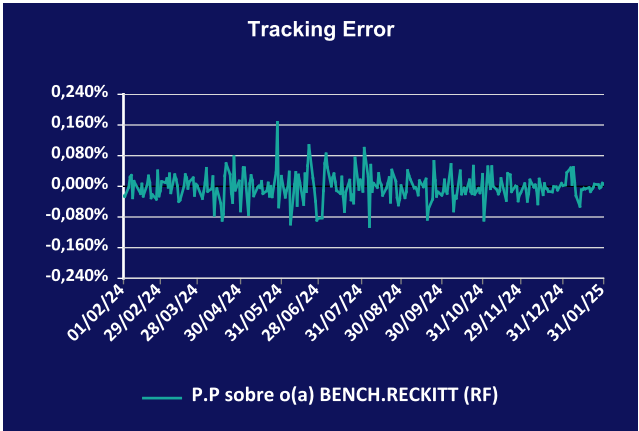
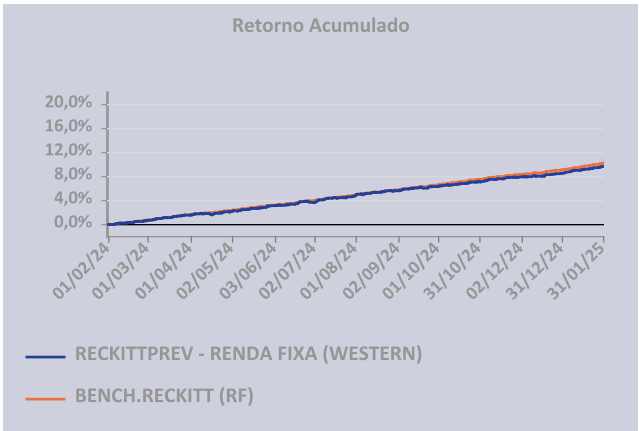
ESTILO: 65,18% | SELEÇÃO: 34,82%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0042%	--
RETORNO ACUMULADO	9,7505%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,2831%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5326%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0845	--
SORTINO	-0,1104	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,4178	--
DOWNSIDE RISK	0,0380%	--
RISCO ATIVO	0,0351%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,5575%	--
RISCO TOTAL	0,0497%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7900%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	5
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	7
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	1,09%	1,09%	9,75%	24,15%	36,35%	0,21% (28/05/2024)	-0,11% (06/08/2024)
BENCH.RECKITT (RF)	1,06%	1,06%	10,28%	24,28%	40,02%	0,15% (19/12/2024)	-0,05% (12/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,04% (01/02/2024)	-0,00% (09/08/2024)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,04% (01/02/2024)	-0,01% (01/08/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	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: 3,55996
PATRIMÔNIO: 144.396.119,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	77,15%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	16,31%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	6,55%	DÓLAR PTAX	0,00%

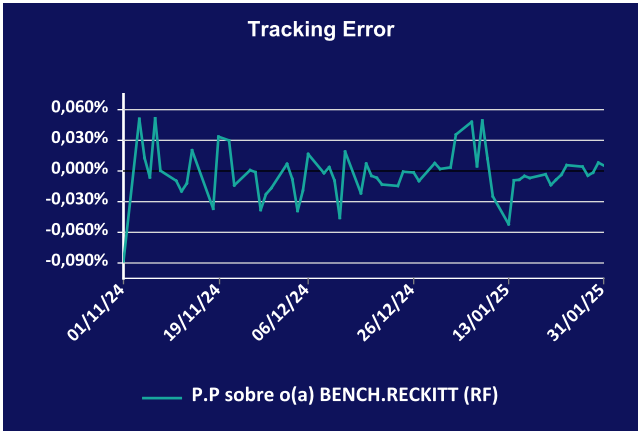
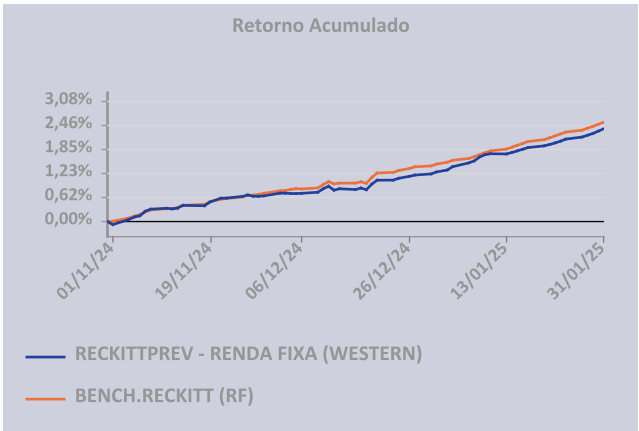
ESTILO: 69,72% | SELEÇÃO: 30,28%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0060%	--
RETORNO ACUMULADO	2,3796%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,5481%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1684%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,1357	--
SORTINO	-0,1700	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,9068	--
DOWNSIDE RISK	0,0353%	--
RISCO ATIVO	0,0242%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,3850%	--
RISCO TOTAL	0,0444%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7058%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,0933%(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	1,09%	1,09%	9,75%	24,15%	36,35%	0,14% (19/12/2024)	-0,10% (12/12/2024)
BENCH.RECKITT (RF)	1,06%	1,06%	10,28%	24,28%	40,02%	0,15% (19/12/2024)	-0,05% (12/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (01/11/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,02% (02/12/2024)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,02% (02/12/2024)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,78% (07/11/2024)

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: 3,55996
PATRIMÔNIO: 144.396.119,35

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	88,56%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	1,30%	IMA B 5+	1,10%
IMA-C	9,04%	DÓLAR PTAX	0,00%

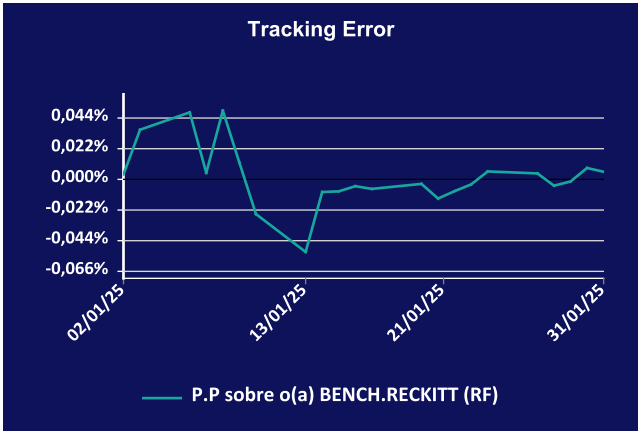
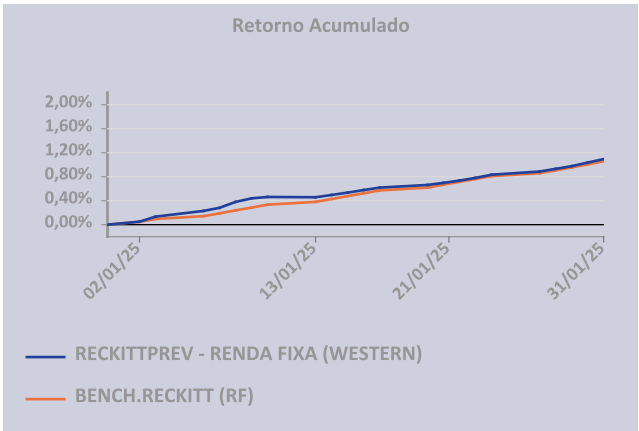
ESTILO: 20,66% | SELEÇÃO: 79,34%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0036%	--
RETORNO ACUMULADO	1,0933%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0578%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0355%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1633	--
SORTINO	0,2918	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,9128	--
DOWNSIDE RISK	0,0123%	--
RISCO ATIVO	0,0219%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,3489%	--
RISCO TOTAL	0,0221%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,3523%	--

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	1,0933%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	1,0933%(01/2025)



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	1,09%	1,09%	9,75%	24,15%	36,35%	0,10% (08/01/2025)	-0,01% (13/01/2025)
BENCH.RECKITT (RF)	1,06%	1,06%	10,28%	24,28%	40,02%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (29/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (07/01/2025)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,64% (30/01/2025)	-0,26% (16/01/2025)
IMA-S	1,10%	1,10%	11,24%	25,78%	42,25%	0,08% (06/01/2025)	0,04% (08/01/2025)
IMA-B	1,07%	1,07%	-0,95%	14,43%	22,62%	1,11% (30/01/2025)	-0,35% (17/01/2025)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,61% (30/01/2025)	-0,13% (21/01/2025)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-0,64% (17/01/2025)
IMA-GERAL	1,40%	1,40%	6,07%	21,49%	33,88%	0,43% (30/01/2025)	-0,09% (10/01/2025)
IPCA	0,16%	0,16%	4,56%	9,27%	15,58%	0,01% (02/01/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,00%	0,00%	4,17%	8,15%	14,33%	0,00% (02/01/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	0,95% (08/01/2025)	-1,27% (22/01/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Janeiro/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: 2,20192
PATRIMÔNIO: 10.396.917,40

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	3,86%	IBX	90,46%
IVBX-2	3,49%	SMLL	2,08%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,11%
IMA-B	0,00%		

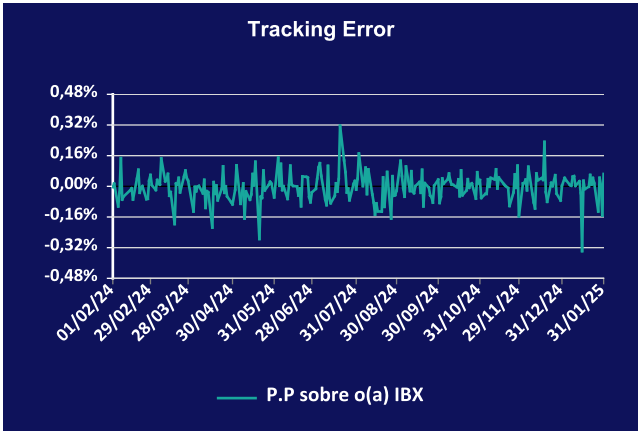
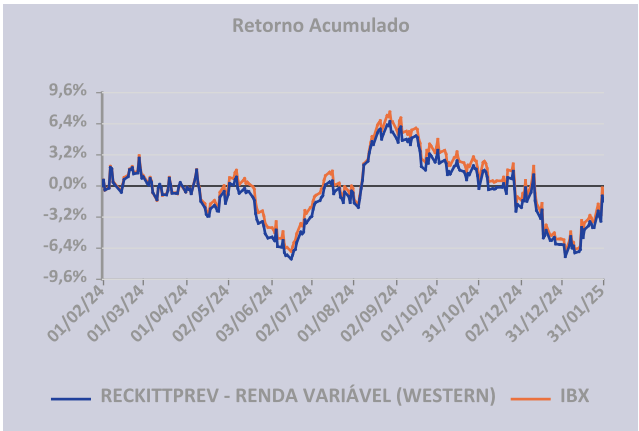
ESTILO: 99,38% | SELEÇÃO: 0,62%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0438%	16° de 25
RETORNO ACUMULADO	-1,5592%	16° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	-0,8013%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7578%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0017%	12° de 25
BETA	0,9685	22° de 25
MARKET TIMING	-0,3804	20° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9929	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	27,3406%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	72,7923%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,6874	15° de 25
JENSEN	-1,1214%	15° de 25
MODIGLIANI	-1,1113%	15° de 25
SHARPE	-0,0530	15° de 25
SORTINO	-0,0717	15° de 25
TREYNOR	-0,0004	15° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,9845	--
DOWNSIDE RISK	0,6107%	20° de 25
RISCO ATIVO	0,0744%	11° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,1823%	11° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0696%	10° de 25
RISCO TOTAL	0,8256%	23° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,1062%	23° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	5
MESES NEGATIVOS	7
MESES ACIMA DO IBX	6
MESES ABAIXO DO IBX	6
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	4,74%	4,74%	-1,56%	8,85%	9,33%	2,68% (30/01/2025)	-2,93% (18/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-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: 2,20192
PATRIMÔNIO: 10.396.917,40

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	5,09%	IBX	92,18%
IVBX-2	2,74%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,00%		

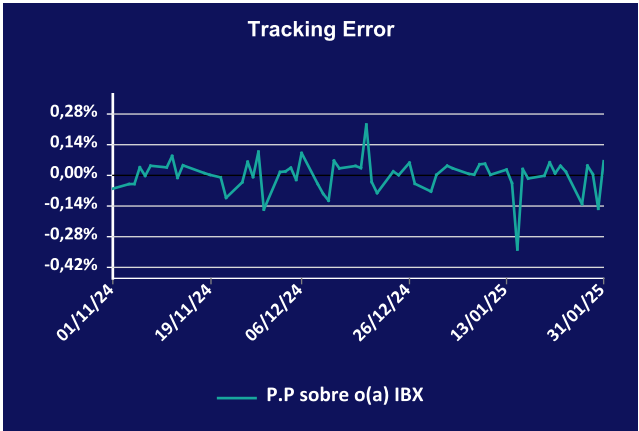
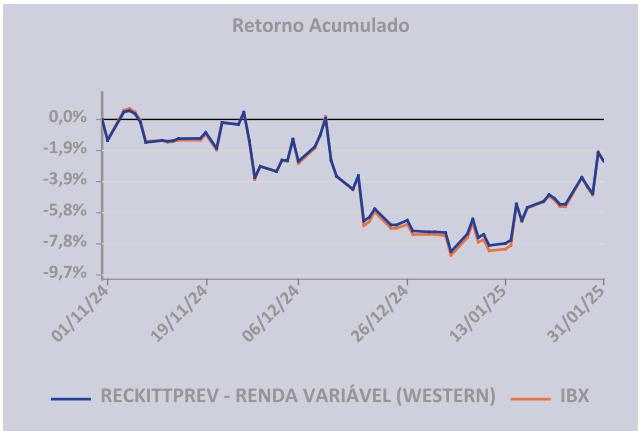
ESTILO: 99,75% | SELEÇÃO: 0,25%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0804%	15° de 25
RETORNO ACUMULADO	-2,5964%	15° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	-2,5999%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0035%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0037%	2° de 25
BETA	0,9510	23° de 25
MARKET TIMING	-0,6225	22° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9976	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	35,3771%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	94,2228%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,1081	15° de 25
JENSEN	-0,2502%	16° de 25
MODIGLIANI	-0,2556%	16° de 25
SHARPE	-0,0732	16° de 25
SORTINO	-0,0970	16° de 25
TREYNOR	-0,0008	16° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	8,1483	--
DOWNSIDE RISK	0,8286%	21° de 25
RISCO ATIVO	0,0773%	13° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,2281%	13° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0549%	11° de 25
RISCO TOTAL	1,0977%	23° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,4256%	23° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	2
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	4,74%	4,74%	-1,56%	8,85%	9,33%	2,68% (30/01/2025)	-2,93% (18/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (01/11/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-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: 2,20192
PATRIMÔNIO: 10.396.917,40

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	6,56%	IBX	87,67%
IVBX-2	3,19%	SMLL	0,00%
IDIV	2,58%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,00%		

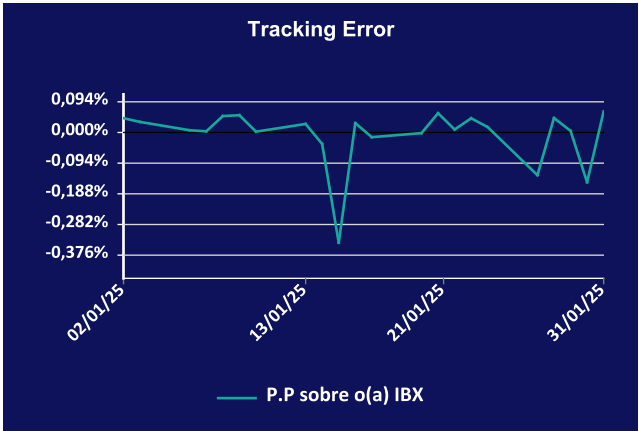
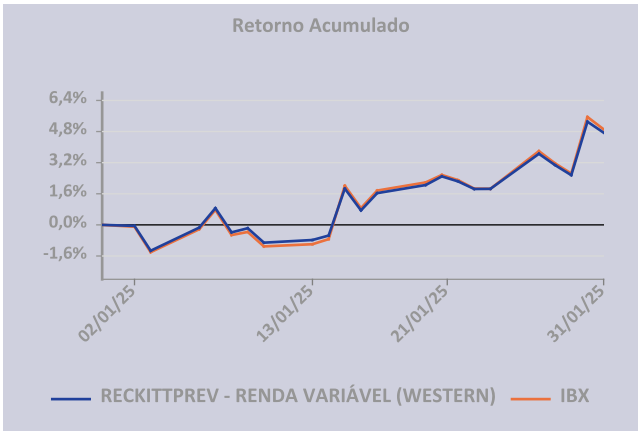
ESTILO: 99,75% | SELEÇÃO: 0,25%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,1706%	24° de 25
RETORNO ACUMULADO	4,7437%	23° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	4,9169%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1731%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0295%	3° de 25
BETA	0,9702	21° de 25
MARKET TIMING	-2,4731	23° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9986	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	98,5218%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	99,9471%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,4355	21° de 25
JENSEN	0,0735%	13° de 25
MODIGLIANI	0,0734%	13° de 25
SHARPE	0,1568	13° de 25
SORTINO	0,3114	25° de 25
TREYNOR	0,0018	13° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	8,1057	--
DOWNSIDE RISK	0,5480%	20° de 25
RISCO ATIVO	0,0915%	9° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,4538%	9° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0548%	10° de 25
RISCO TOTAL	1,0881%	24° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,2736%	24° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	4,7438%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	4,7438%(01/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	4,74%	4,74%	-1,56%	8,85%	9,33%	2,68% (30/01/2025)	-1,28% (03/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-1,33% (03/01/2025)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-1,31% (03/01/2025)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-1,72% (03/01/2025)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,6160%	0,9829	-0,0315%	13,2906%	0,15%	168.504.130,54	253
2	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,5272%	0,9907	-0,1820%	13,3664%	0,31%	98.409.774,29	253
3	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,4488%	0,9948	-0,2972%	13,4111%	0,09%	271.178.821,05	253
4	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,4397%	0,9971	-0,3269%	13,4357%	0,10%	466.232.584,90	253
5	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,4285%	0,9985	-0,3557%	13,4568%	0,15%	174.868.975,75	253
6	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,3639%	0,9942	-0,3749%	13,4030%	0,01%	271.221.403,56	253
7	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,2392%	0,9987	-0,5469%	13,4593%	0,30%	70.240.023,64	253
8	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,1590%	0,9957	-0,5916%	13,4180%	0,19%	25.752.814,32	253
9	COMSHELL CONCHA FIA	0,1214%	0,9804	-0,4505%	13,2109%	0,17%	58.378.988,30	253
10	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0798%	0,9852	-0,5489%	13,2775%	0,56%	24.790.818,14	253
11	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0022%	0,9438	-0,1381%	12,7174%	0,30%	31.202.886,02	253
12	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,1548%	0,9714	-0,6310%	13,1084%	0,00%	158.515.866,61	253
13	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,4573%	0,9773	-0,9931%	13,1835%	0,50%	34.470.155,46	253
14	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,7680%	0,9946	-1,5392%	13,4447%	0,90%	168.327.114,22	253
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-1,1113%	0,9685	-1,5592%	13,1062%	0,35%	10.396.917,40	253
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-1,3399%	0,9446	-1,4517%	12,7660%	0,75%	26.779.675,58	253
17	IAJA SAM ACOES FI	-2,6401%	1,0023	-3,5652%	13,5933%	0,22%	31.742.867,87	253
18	IAJA ACOES FC FIA	-3,2371%	0,9926	-4,1216%	13,5521%	0,08%	68.498.062,46	253
19	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-3,3880%	1,1480	-7,8017%	16,6979%	1,70%	17.174.307,34	253
20	DAHLIA ACOES FC FIA	-3,4287%	0,9502	-4,9137%	14,0852%	1,85%	68.492.341,41	253
21	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,5409%	1,0161	-4,6367%	13,7371%	0,70%	11.324.306,53	253
22	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-4,3358%	1,0476	-6,4258%	14,5584%	2,00%	223.448.525,56	253
23	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-4,4471%	1,0475	-6,5454%	14,5579%	2,00%	551.973.087,63	253
24	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-5,2813%	1,0179	-7,2455%	14,3986%	0,41%	246.665.711,68	253
25	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-6,9954%	1,0316	-9,2667%	14,5353%	0,75%	25.896.394,24	253
MÉDIA:		-1,5080%	0,9989	-2,5816%	13,6709%		132.179.462,18	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025

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	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,3802%	0,9694	-2,1083%	17,8598%	0,15%	168.504.130,54	62
2	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,2655%	0,9969	-2,3161%	18,2029%	0,10%	466.232.584,90	62
3	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,2278%	0,9294	-2,0048%	16,9618%	0,30%	31.202.886,02	62
4	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,2119%	0,9978	-2,3780%	18,2329%	0,09%	271.178.821,05	62
5	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,2051%	0,9989	-2,3889%	18,2477%	0,15%	174.868.975,75	62
6	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,1936%	0,9976	-2,3952%	18,2294%	0,01%	271.221.403,56	62
7	COMSHELL CONCHA FIA	0,1770%	0,9784	-2,3090%	17,8673%	0,17%	58.378.988,30	62
8	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,1662%	0,9841	-2,3478%	17,9665%	0,56%	24.790.818,14	62
9	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,1605%	0,9989	-2,4332%	18,2464%	0,30%	70.240.023,64	62
10	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,1447%	1,0006	-2,4573%	18,2757%	0,31%	98.409.774,29	62
11	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,1259%	0,9614	-2,2760%	17,5776%	0,00%	158.515.866,61	62
12	BRADESCO FIA SALUBRE	0,1228%	0,9574	-2,2493%	17,4740%	0,50%	34.470.155,46	62
13	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0876%	0,9967	-2,4935%	18,2033%	0,19%	25.752.814,32	62
14	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,1187%	0,9332	-2,3587%	17,0689%	0,75%	26.779.675,58	62
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,2119%	0,9762	-2,6883%	17,8638%	0,90%	168.327.114,22	62
16	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-0,2557%	0,9511	-2,5964%	17,4257%	0,35%	10.396.917,40	62
17	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,4437%	1,0216	-3,3384%	19,1959%	1,85%	68.492.341,41	62
18	IAJA SAM ACOES FI	-0,6845%	1,0208	-3,4281%	18,7026%	0,22%	31.742.867,87	62
19	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,9311%	1,0165	-3,6404%	18,5859%	0,70%	11.324.306,53	62
20	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-1,1086%	1,1183	-4,6443%	20,9103%	2,00%	223.448.525,56	62
21	IAJA ACOES FC FIA	-1,1279%	1,0207	-3,9049%	18,7669%	0,08%	68.498.062,46	62
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-1,2032%	1,1185	-4,7556%	20,9186%	2,00%	551.973.087,63	62
23	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-2,1157%	1,1375	-6,1227%	21,7057%	1,70%	17.174.307,34	62
24	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-2,2195%	1,1361	-6,1222%	21,4075%	0,75%	25.896.394,24	62
25	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-2,2877%	1,1431	-6,2522%	21,5269%	0,41%	246.665.711,68	62
MÉDIA:		-0,4096%	1,0144	-3,2004%	18,6970%		132.179.462,18	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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 ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,5561%	1,0856	6,1250%	21,1077%	0,41%	246.665.711,68	22
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,4686%	0,9903	5,1952%	17,6141%	0,15%	168.504.130,54	22
3	DAHLIA ACOES FC FIA	0,4616%	1,1007	5,7069%	19,8009%	1,85%	68.492.341,41	22
4	IAJA SAM ACOES FI	0,3540%	0,9922	5,3010%	18,5457%	0,22%	31.742.867,87	22
5	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,3357%	1,0880	5,7823%	20,7164%	0,75%	25.896.394,24	22
6	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,1964%	0,9641	4,9817%	17,8245%	0,90%	168.327.114,22	22
7	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,1779%	0,9725	4,9299%	17,6716%	0,00%	158.515.866,61	22
8	OCEANA VALOR FC FI ACOES	0,1314%	1,1061	5,6677%	21,2420%	2,00%	223.448.525,56	22
9	RPS FIC FI ACOES SELECTION	0,1180%	1,0741	5,3959%	20,0683%	1,70%	17.174.307,34	22
10	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,1147%	0,9866	5,0484%	18,4922%	0,70%	11.324.306,53	22
11	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,1041%	1,1037	5,6227%	21,1803%	2,00%	551.973.087,63	22
12	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	0,0920%	0,9574	4,7578%	17,2581%	0,75%	26.779.675,58	22
13	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	0,0734%	0,9702	4,7438%	17,2737%	0,35%	10.396.917,40	22
14	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0559%	1,0004	4,9736%	18,4193%	0,10%	466.232.584,90	22
15	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0349%	0,9471	4,7165%	17,3152%	0,30%	31.202.886,02	22
16	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0332%	0,9996	4,9481%	18,4059%	0,15%	174.868.975,75	22
17	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,0311%	0,9983	4,9352%	18,3554%	0,09%	271.178.821,05	22
18	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,0244%	0,9981	4,9277%	18,3518%	0,01%	271.221.403,56	22
19	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0188%	0,9994	4,9330%	18,4026%	0,30%	70.240.023,64	22
20	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0091%	0,9973	4,9183%	18,3791%	0,19%	25.752.814,32	22
21	IAJA ACOES FC FIA	0,0075%	1,0133	5,0100%	18,8184%	0,08%	68.498.062,46	22
22	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,0050%	1,0015	4,9279%	18,4437%	0,31%	98.409.774,29	22
23	COMSHELL CONCHA FIA	-0,0010%	0,9790	4,8353%	18,0353%	0,17%	58.378.988,30	22
24	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,0203%	0,9558	4,7384%	17,6648%	0,50%	34.470.155,46	22
25	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0260%	0,9918	4,8660%	18,2970%	0,56%	24.790.818,14	22
MÉDIA:		0,1343%	1,0109	5,1195%	18,7074%		132.179.462,18	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:01/02/2024 A 31/01/2025

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	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-0,0315%	0,5778%	0,9829	13,2906%	0,15%	168.504.130,54	253
2	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1381%	-0,0026%	0,9438	12,7174%	0,30%	31.202.886,02	253
3	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	-0,1820%	0,5087%	0,9907	13,3664%	0,31%	98.409.774,29	253
4	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,2972%	0,4427%	0,9948	13,4111%	0,09%	271.178.821,05	253
5	SANTANDER FI IBRX ACOES	-0,3269%	0,4379%	0,9971	13,4357%	0,10%	466.232.584,90	253
6	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-0,3557%	0,4274%	0,9985	13,4568%	0,15%	174.868.975,75	253
7	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,3749%	0,3579%	0,9942	13,4030%	0,01%	271.221.403,56	253
8	COMSHELL CONCHA FIA	-0,4505%	0,1184%	0,9804	13,2109%	0,17%	58.378.988,30	253
9	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-0,5469%	0,2384%	0,9987	13,4593%	0,30%	70.240.023,64	253
10	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,5489%	0,0746%	0,9852	13,2775%	0,56%	24.790.818,14	253
11	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-0,5916%	0,1578%	0,9957	13,4180%	0,19%	25.752.814,32	253
12	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,6310%	-0,1654%	0,9714	13,1084%	0,00%	158.515.866,61	253
13	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,9931%	-0,4622%	0,9773	13,1835%	0,50%	34.470.155,46	253
14	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-1,4517%	-1,3012%	0,9446	12,7660%	0,75%	26.779.675,58	253
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-1,5392%	-0,7998%	0,9946	13,4447%	0,90%	168.327.114,22	253
16	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-1,5592%	-1,1214%	0,9685	13,1062%	0,35%	10.396.917,40	253
17	IAJA SAM ACOES FI	-3,5652%	-2,7387%	1,0023	13,5933%	0,22%	31.742.867,87	253
18	IAJA ACOES FC FIA	-4,1216%	-3,4103%	0,9926	13,5521%	0,08%	68.498.062,46	253
19	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-4,6367%	-3,6539%	1,0161	13,7371%	0,70%	11.324.306,53	253
20	DAHLIA ACOES FC FIA	-4,9137%	-4,6640%	0,9502	14,0852%	1,85%	68.492.341,41	253
21	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-6,4258%	-5,0773%	1,0476	14,5584%	2,00%	223.448.525,56	253
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-6,5454%	-5,1952%	1,0475	14,5579%	2,00%	551.973.087,63	253
23	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-7,2455%	-6,2020%	1,0179	14,3986%	0,41%	246.665.711,68	253
24	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-7,8017%	-5,2347%	1,1480	16,6979%	1,70%	17.174.307,34	253
25	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-9,2667%	-8,0682%	1,0316	14,5353%	0,75%	25.896.394,24	253
MÉDIA:		-2,5816%	-1,7902%	0,9989	13,6709%		132.179.462,18	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025

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	-2,0048%	0,2102%	0,9294	16,9618%	0,30%	31.202.886,02	62
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-2,1083%	0,3429%	0,9694	17,8598%	0,15%	168.504.130,54	62
3	BRADESCO FIA SALUBRE	-2,2493%	0,1166%	0,9574	17,4740%	0,50%	34.470.155,46	62
4	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-2,2760%	0,1183%	0,9614	17,5776%	0,00%	158.515.866,61	62
5	COMSHELL CONCHA FIA	-2,3090%	0,1729%	0,9784	17,8673%	0,17%	58.378.988,30	62
6	SANTANDER FI IBRX ACOES	-2,3161%	0,2644%	0,9969	18,2029%	0,10%	466.232.584,90	62
7	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-2,3478%	0,1622%	0,9841	17,9665%	0,56%	24.790.818,14	62
8	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,3587%	-0,1168%	0,9332	17,0689%	0,75%	26.779.675,58	62
9	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-2,3780%	0,2095%	0,9978	18,2329%	0,09%	271.178.821,05	62
10	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-2,3889%	0,2048%	0,9989	18,2477%	0,15%	174.868.975,75	62
11	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-2,3952%	0,1912%	0,9976	18,2294%	0,01%	271.221.403,56	62
12	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-2,4332%	0,1601%	0,9989	18,2464%	0,30%	70.240.023,64	62
13	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	-2,4573%	0,1446%	1,0006	18,2757%	0,31%	98.409.774,29	62
14	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-2,4935%	0,0872%	0,9967	18,2033%	0,19%	25.752.814,32	62
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-2,5964%	-0,2503%	0,9511	17,4257%	0,35%	10.396.917,40	62
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-2,6883%	-0,2133%	0,9762	17,8638%	0,90%	168.327.114,22	62
17	DAHLIA ACOES FC FIA	-3,3384%	-0,6214%	1,0216	19,1959%	1,85%	68.492.341,41	62
18	IAJA SAM ACOES FI	-3,4281%	-0,7260%	1,0208	18,7026%	0,22%	31.742.867,87	62
19	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-3,6404%	-0,9622%	1,0165	18,5859%	0,70%	11.324.306,53	62
20	IAJA ACOES FC FIA	-3,9049%	-1,2025%	1,0207	18,7669%	0,08%	68.498.062,46	62
21	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-4,6443%	-1,4220%	1,1183	20,9103%	2,00%	223.448.525,56	62
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-4,7556%	-1,5294%	1,1185	20,9186%	2,00%	551.973.087,63	62
23	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-6,1222%	-2,7789%	1,1361	21,4075%	0,75%	25.896.394,24	62
24	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-6,1227%	-2,7667%	1,1375	21,7057%	1,70%	17.174.307,34	62
25	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-6,2522%	-2,8778%	1,1431	21,5269%	0,41%	246.665.711,68	62
	MÉDIA:	-3,2004%	-0,5233%	1,0144	18,6970%		132.179.462,18	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025
 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	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	6,1250%	0,8051%	1,0856	21,1077%	0,41%	246.665.711,68	22
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	5,7823%	0,5370%	1,0880	20,7164%	0,75%	25.896.394,24	22
3	DAHLIA ACOES FC FIA	5,7069%	0,5718%	1,1007	19,8009%	1,85%	68.492.341,41	22
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	5,6677%	0,2355%	1,1061	21,2420%	2,00%	223.448.525,56	22
5	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	5,6227%	0,2026%	1,1037	21,1803%	2,00%	551.973.087,63	22
6	RPS FIC FI ACOES SELECTION	5,3959%	0,2023%	1,0741	20,0683%	1,70%	17.174.307,34	22
7	IAJA SAM ACOES FI	5,3010%	0,3652%	0,9922	18,5457%	0,22%	31.742.867,87	22
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	5,1952%	0,5059%	0,9903	17,6141%	0,15%	168.504.130,54	22
9	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	5,0484%	0,1192%	0,9866	18,4922%	0,70%	11.324.306,53	22
10	IAJA ACOES FC FIA	5,0100%	0,0273%	1,0133	18,8184%	0,08%	68.498.062,46	22
11	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	4,9817%	0,1937%	0,9641	17,8245%	0,90%	168.327.114,22	22
12	SANTANDER FI IBRX ACOES	4,9736%	0,0559%	1,0004	18,4193%	0,10%	466.232.584,90	22
13	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	4,9481%	0,0332%	0,9996	18,4059%	0,15%	174.868.975,75	22
14	BB ECO GOLD FI EM ACOES	4,9352%	0,0311%	0,9983	18,3554%	0,09%	271.178.821,05	22
15	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	4,9330%	0,0189%	0,9994	18,4026%	0,30%	70.240.023,64	22
16	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	4,9299%	0,1720%	0,9725	17,6716%	0,00%	158.515.866,61	22
17	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	4,9279%	0,0051%	1,0015	18,4437%	0,31%	98.409.774,29	22
18	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	4,9277%	0,0244%	0,9981	18,3518%	0,01%	271.221.403,56	22
19	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	4,9183%	0,0091%	0,9973	18,3791%	0,19%	25.752.814,32	22
20	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	4,8660%	-0,0253%	0,9918	18,2970%	0,56%	24.790.818,14	22
21	COMSHELL CONCHA FIA	4,8353%	-0,0009%	0,9790	18,0353%	0,17%	58.378.988,30	22
22	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	4,7578%	0,0890%	0,9574	17,2581%	0,75%	26.779.675,58	22
23	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	4,7438%	0,0736%	0,9702	17,2737%	0,35%	10.396.917,40	22
24	BRADESCO FIA SALUBRE	4,7384%	-0,0192%	0,9558	17,6648%	0,50%	34.470.155,46	22
25	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	4,7165%	0,0333%	0,9471	17,3152%	0,30%	31.202.886,02	22
MÉDIA:		5,1195%	0,1706%	1,0109	18,7074%		132.179.462,18	

ReckittPREV

Agrupamento: Multimercados
CONSERVADOR

Janeiro/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: 1,17907
PATRIMÔNIO: 16.153.252,73

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	90,19%	IBOVESPA	2,66%
IVBX-2	1,39%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	5,75%	DÓLAR PTAX	0,00%

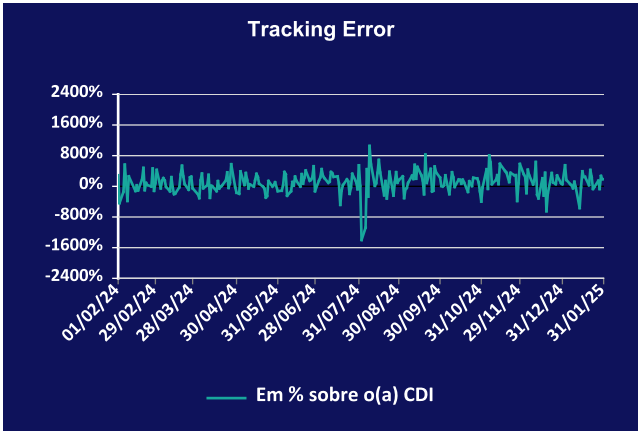
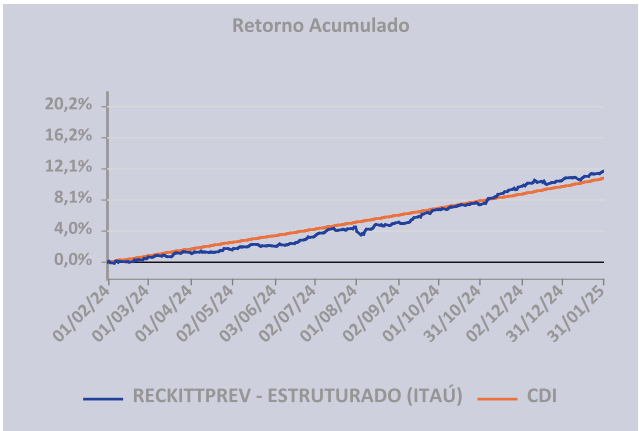
ESTILO: 11,09% | SELEÇÃO: 88,91%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0033%	5° de 39
RETORNO ACUMULADO	11,8396%	5° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,9270%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	108,3516%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0023	6° de 39
SHARPE	0,0292	5° de 39
SORTINO	0,0402	6° de 39
STERLING RATIO	0,0276	6° de 39
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,7157	--
DOWNSIDE RISK	0,0820%	19° de 39
RISCO ATIVO	276,7506%	19° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,7917%	19° de 39
RISCO TOTAL	0,1128%	19° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7913%	19° 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	1,14%	1,14%	11,84%	--	--	0,41% (08/08/2024)	-0,55% (02/08/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	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: 1,17907
PATRIMÔNIO: 16.153.252,73

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	62,32%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,02%
IDIV	1,70%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	35,96%	DÓLAR PTAX	0,00%

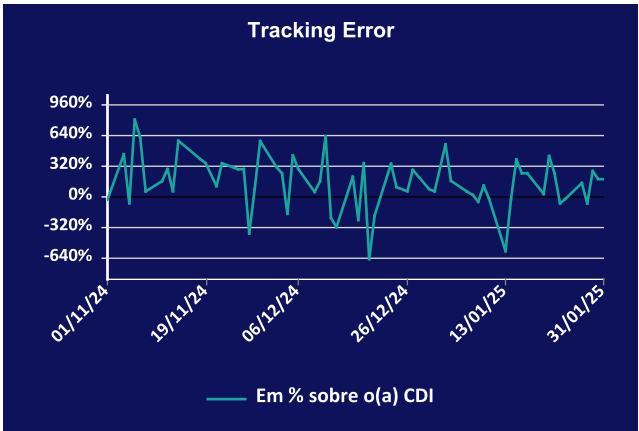
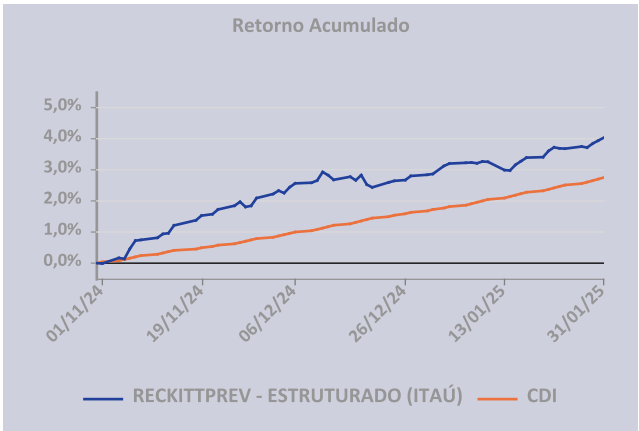
ESTILO: 9,93% | SELEÇÃO: 90,07%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0201%	3° de 39
RETORNO ACUMULADO	4,0480%	3° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,7625%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	146,5308%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0339	2° de 36
SHARPE	0,1667	3° de 39
SORTINO	0,2511	3° de 39
STERLING RATIO	0,1558	2° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,6397	--
DOWNSIDE RISK	0,0801%	20° de 39
RISCO ATIVO	277,1895%	18° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,9167%	18° de 39
RISCO TOTAL	0,1201%	18° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,9070%	18° de 39

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO CDI	2
MESES ABAIXO DO CDI	1
MAIOR RETORNO MENSAL	2,0997%(11/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7633%(12/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,14%	1,14%	11,84%	--	--	0,32% (06/11/2024)	-0,29% (19/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (01/11/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,78% (07/11/2024)

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: 1,17907
PATRIMÔNIO: 16.153.252,73

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	95,25%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	1,11%
IDIV	0,00%	IRF-M	3,08%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,56%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

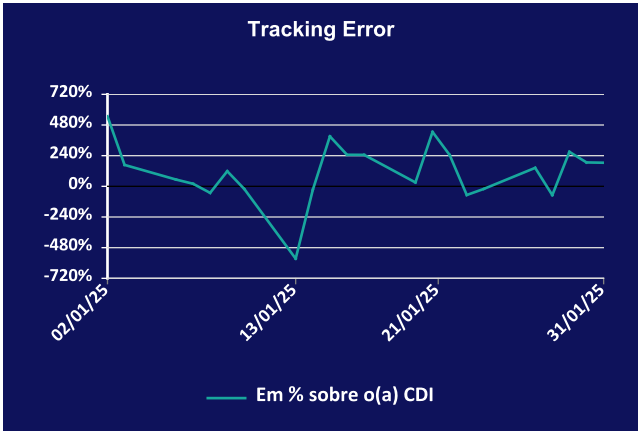
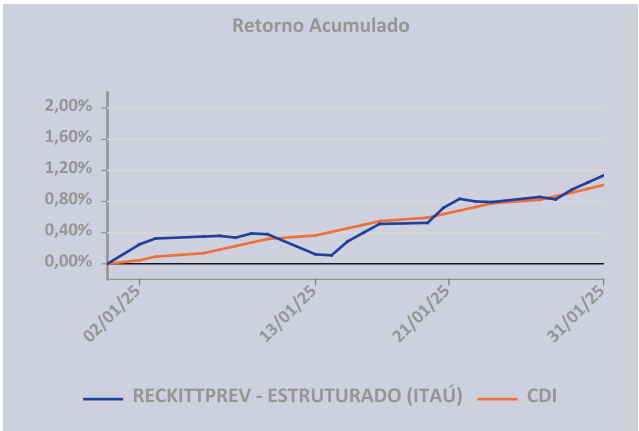
ESTILO: 5,55% | SELEÇÃO: 94,45%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0055%	8° de 39
RETORNO ACUMULADO	1,1362%	8° de 39
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0132%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	112,1470%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0195	9° de 33
SHARPE	0,0539	11° de 39
SORTINO	0,0755	11° de 39
STERLING RATIO	0,0594	9° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,5636	--
DOWNSIDE RISK	0,0740%	17° de 39
RISCO ATIVO	227,2886%	14° de 39
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,6437%	15° de 39
RISCO TOTAL	0,1036%	14° de 39
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,6456%	14° de 39

PERFIL DE RETORNOS

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



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,14%	1,14%	11,84%	--	--	0,25% (02/01/2025)	-0,26% (13/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-1,33% (03/01/2025)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-1,31% (03/01/2025)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-1,72% (03/01/2025)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,64% (30/01/2025)	-0,26% (16/01/2025)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,61% (30/01/2025)	-0,13% (21/01/2025)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-0,64% (17/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	0,95% (08/01/2025)	-1,27% (22/01/2025)

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,0567	13,2332%	0,0082%	2,3056%	2,50%	63.432.046,20	253
2	ITAU HEDGE MULT FI	0,0412	12,6602%	0,0062%	2,4025%	2,00%	253.672.391,71	253
3	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,0329	11,6752%	0,0027%	1,2965%	2,00%	91.981.016,39	253
4	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	0,0294	11,8494%	0,0033%	1,8006%	1,50%	2.085.373.904,85	253
5	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	0,0293	11,8396%	0,0033%	1,7914%	0,30%	16.153.252,73	253
6	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,0285	12,0254%	0,0040%	2,2274%	2,00%	1.470.861.404,56	253
7	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0201	11,2780%	0,0013%	1,0029%	1,75%	1.990.198.395,70	253
8	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,0078	11,1889%	0,0010%	2,0723%	2,50%	76.169.907,23	253
9	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,0053	10,8790%	-0,0002%	0,5006%	0,50%	580.345.989,99	253
10	SIC SCHRODERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,0153	10,8218%	-0,0004%	0,3862%	0,70%	118.572.783,93	253
11	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0268	10,4516%	-0,0017%	0,9954%	2,00%	84.621.037,57	253
12	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,0387	10,8029%	-0,0004%	0,1828%	0,35%	102.201.246,43	253
13	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,0397	9,5186%	-0,0050%	1,9907%	0,14%	105.905.769,63	253
14	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,0440	9,4264%	-0,0053%	1,9183%	0,08%	115.580.603,75	253
15	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,0468	9,4692%	-0,0052%	1,7560%	1,50%	73.413.330,87	253
16	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,0586	9,1036%	-0,0065%	1,7604%	0,35%	52.137.765,77	253
17	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,0592	10,1614%	-0,0027%	0,7312%	1,00%	58.274.702,35	253
18	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,0593	9,6974%	-0,0044%	1,1727%	2,00%	129.660.239,20	253
19	SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	-0,0611	8,2535%	-0,0095%	2,4726%	2,00%	249.368.189,84	253
20	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,0612	8,5296%	-0,0085%	2,2175%	2,50%	118.474.032,09	253
21	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,0627	8,7622%	-0,0077%	1,9513%	1,90%	2.758.140.426,09	253
22	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,0833	10,0218%	-0,0032%	0,6178%	0,90%	113.066.544,02	253
23	PORTO SEGURO ALOCACAO FC FI MULT	-0,0866	7,4192%	-0,0126%	2,3095%	0,50%	140.491.612,66	253
24	SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,0913	7,5648%	-0,0121%	2,0980%	2,00%	62.406.775,33	253
25	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	-0,0918	9,0954%	-0,0066%	1,1311%	1,00%	341.932.225,45	253
26	FOF FRG FC FI MULT	-0,1066	6,7035%	-0,0152%	2,2699%	0,00%	576.559.958,09	253
27	SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	-0,1231	9,8366%	-0,0039%	0,5041%	0,50%	235.372.731,04	253
28	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,1247	7,5718%	-0,0121%	1,5402%	0,96%	942.162.728,12	253
29	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	-0,1290	9,0227%	-0,0068%	0,8405%	1,00%	74.744.468,94	253
30	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,1320	5,6790%	-0,0191%	2,2922%	2,00%	659.465.559,88	253
31	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1398	6,3917%	-0,0164%	1,8656%	1,00%	115.124.068,96	253
32	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1442	7,5394%	-0,0122%	1,3470%	1,50%	176.349.279,58	253
33	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,1575	5,3683%	-0,0202%	2,0413%	2,00%	108.960.613,98	253
34	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1618	5,7105%	-0,0190%	1,8635%	2,50%	79.241.587,03	253

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:01/02/2024 A 31/01/2025

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	-0,1788	3,3710%	-0,0278%	2,4663%	1,50%	799.301.296,00	253
36		MAG STRATEGY FI MULT	-0,1813	7,5945%	-0,0120%	1,0572%	0,85%	98.180.683,65	253
37		CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,2143	9,5157%	-0,0051%	0,3772%	0,70%	845.030.575,70	253
38		BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,2305	8,2466%	-0,0097%	0,6674%	1,00%	9.212.667.345,12	253
39		VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,2427	8,9256%	-0,0072%	0,4730%	1,00%	139.378.872,28	253
MÉDIA:			-0,0757	9,1591%	-0,0064%	1,5050%		649.101.932,38	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025

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 GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,1823	4,4390%	0,0262%	2,2732%	2,00%	1.470.861.404,56	62
2	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	0,1670	4,0561%	0,0203%	1,9161%	1,50%	2.085.373.904,85	62
3	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	0,1667	4,0480%	0,0201%	1,9071%	0,30%	16.153.252,73	62
4	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	0,1016	3,8352%	0,0169%	2,6355%	2,50%	118.474.032,09	62
5	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	0,1005	3,0722%	0,0049%	0,7650%	0,50%	580.345.989,99	62
6	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,0850	3,5121%	0,0118%	2,2029%	2,50%	63.432.046,20	62
7	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	0,0819	3,6659%	0,0143%	2,7672%	1,50%	73.413.330,87	62
8	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	0,0775	3,4734%	0,0112%	2,2923%	0,14%	105.905.769,63	62
9	ITAU HEDGE MULT FI	0,0773	3,7007%	0,0148%	3,0480%	2,00%	253.672.391,71	62
10	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,0588	3,0517%	0,0046%	1,2265%	2,00%	91.981.016,39	62
11	OCCAM INST FC FI MULT II	0,0556	3,1158%	0,0056%	1,5893%	2,00%	129.660.239,20	62
12	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0529	2,8757%	0,0018%	0,5369%	1,75%	1.990.198.395,70	62
13	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	0,0352	3,0860%	0,0052%	2,3321%	0,08%	115.580.603,75	62
14	SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	0,0094	2,7908%	0,0005%	0,7630%	0,50%	235.372.731,04	62
15	FOF FRG FC FI MULT	-0,0003	2,7487%	-0,0001%	2,8333%	0,00%	576.559.958,09	62
16	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,0217	2,5494%	-0,0032%	2,3636%	0,50%	140.491.612,66	62
17	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	-0,0231	2,5173%	-0,0037%	2,5611%	2,50%	76.169.907,23	62
18	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,0233	2,7392%	-0,0004%	0,2471%	0,35%	102.201.246,43	62
19	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	-0,0249	2,6432%	-0,0018%	1,1754%	1,00%	74.744.468,94	62
20	SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,0408	2,1370%	-0,0096%	3,7193%	2,00%	62.406.775,33	62
21	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0411	2,6073%	-0,0024%	0,9382%	2,00%	84.621.037,57	62
22	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,0436	2,4666%	-0,0046%	1,6739%	1,50%	176.349.279,58	62
23	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0583	2,2676%	-0,0077%	2,0948%	2,00%	659.465.559,88	62
24	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,0590	2,2429%	-0,0081%	2,1698%	1,90%	2.758.140.426,09	62
25	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	-0,0663	2,0801%	-0,0106%	2,5501%	0,35%	52.137.765,77	62
26	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,0773	2,3491%	-0,0065%	1,3281%	0,96%	942.162.728,12	62
27	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,1053	2,5331%	-0,0036%	0,5451%	0,70%	118.572.783,93	62
28	MAG STRATEGY FI MULT	-0,1055	2,2925%	-0,0074%	1,1161%	0,85%	98.180.683,65	62
29	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1088	2,1511%	-0,0096%	1,4031%	2,50%	79.241.587,03	62
30	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,1320	1,9071%	-0,0134%	1,6228%	2,00%	108.960.613,98	62
31	SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	-0,2290	0,3825%	-0,0377%	2,6128%	2,00%	249.368.189,84	62
32	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,2373	2,3394%	-0,0067%	0,4535%	1,00%	58.274.702,35	62
33	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	-0,2429	1,2672%	-0,0236%	1,5445%	1,00%	341.932.225,45	62
34	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,2533	2,6245%	-0,0022%	0,1394%	0,90%	113.066.544,02	62

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:01/11/2024 A 31/01/2025

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 LP EMPRESA FC	-0,3102	0,5792%	-0,0346%	1,7785%	1,00%	115.124.068,96	62
36		BB MULT MACRO LP FC	-0,3362	0,1621%	-0,0413%	1,9578%	1,50%	799.301.296,00	62
37		BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,3623	2,1130%	-0,0102%	0,4530%	1,00%	9.212.667.345,12	62
38		CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,3625	2,5909%	-0,0027%	0,1201%	0,70%	845.030.575,70	62
39		VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,5949	2,5429%	-0,0035%	0,0988%	1,00%	139.378.872,28	62
MÉDIA:			-0,0669	2,6040%	-0,0025%	1,6347%		649.101.932,38	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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	0,4416	2,5746%	0,0699%	2,5187%	2,00%	253.672.391,71	22
2	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	0,3883	1,2072%	0,0087%	0,3565%	0,70%	118.572.783,93	22
3	MAG MULT FIF RESP LIM	0,3319	1,0522%	0,0018%	0,0819%	0,90%	113.066.544,02	22
4	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	0,2214	2,0692%	0,0475%	3,4085%	0,35%	52.137.765,77	22
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,1767	1,2920%	0,0126%	1,1242%	2,00%	84.621.037,57	22
6	BB MULT LP EMPRESA FC	0,1427	1,1333%	0,0054%	0,6001%	1,00%	115.124.068,96	22
7	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	0,1163	1,2028%	0,0086%	1,1653%	1,00%	74.744.468,94	22
8	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,0771	1,2920%	0,0127%	2,6036%	2,50%	76.169.907,23	22
9	BB MULT MACRO LP FC	0,0720	1,0843%	0,0032%	0,7065%	1,50%	799.301.296,00	22
10	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	0,0541	1,1372%	0,0056%	1,6543%	1,50%	2.085.373.904,85	22
11	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	0,0540	1,1363%	0,0056%	1,6457%	0,30%	16.153.252,73	22
12	AZ QUEST MULT FC FI MULT	0,0448	1,0770%	0,0029%	1,0236%	2,50%	79.241.587,03	22
13	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,0420	1,1294%	0,0053%	2,0042%	2,00%	1.470.861.404,56	22
14	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0224	1,0254%	0,0005%	0,3907%	1,75%	1.990.198.395,70	22
15	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	0,0096	1,0247%	0,0005%	0,8841%	1,00%	341.932.225,45	22
16	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,0100	1,0114%	-0,0001%	0,1266%	0,70%	845.030.575,70	22
17	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0171	0,9579%	-0,0024%	2,2272%	2,00%	659.465.559,88	22
18	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,0196	0,9357%	-0,0034%	2,7190%	2,50%	118.474.032,09	22
19	MAG STRATEGY FI MULT	-0,0499	0,9221%	-0,0041%	1,3022%	0,85%	98.180.683,65	22
20	SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	-0,0521	0,8921%	-0,0054%	1,6425%	2,00%	249.368.189,84	22
21	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,0715	0,8520%	-0,0072%	1,6062%	0,50%	140.491.612,66	22
22	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,0737	0,7818%	-0,0103%	2,2225%	1,50%	176.349.279,58	22
23	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,0979	0,7315%	-0,0126%	2,0497%	0,14%	105.905.769,63	22
24	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	-0,1490	0,7377%	-0,0124%	1,3144%	2,50%	63.432.046,20	22
25	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	-0,1713	0,8257%	-0,0084%	0,7769%	2,00%	91.981.016,39	22
26	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,1764	0,6138%	-0,0180%	1,6209%	1,90%	2.758.140.426,09	22
27	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,2147	0,8977%	-0,0052%	0,3852%	1,00%	58.274.702,35	22
28	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,2189	0,3903%	-0,0280%	2,0376%	0,08%	115.580.603,75	22
29	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,2284	0,5290%	-0,0218%	1,5115%	2,00%	129.660.239,20	22
30	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,2292	0,9427%	-0,0032%	0,2157%	1,00%	9.212.667.345,12	22
31	FOF FRG FC FI MULT	-0,2380	0,2329%	-0,0352%	2,3496%	0,00%	576.559.958,09	22
32	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,2388	0,5074%	-0,0228%	1,5108%	0,96%	942.162.728,12	22
33	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,2583	0,9871%	-0,0012%	0,0719%	1,00%	139.378.872,28	22
34	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,2695	0,3384%	-0,0304%	1,7929%	1,50%	73.413.330,87	22

SHARPE

PERÍODO DA ANALISE:02/01/2025 A 31/01/2025

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 CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,2830	0,8173%	-0,0088%	0,4903%	0,50%	580.345.989,99	22
36		SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,2990	-0,6987%	-0,0774%	4,1002%	2,00%	62.406.775,33	22
37		ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,3335	0,9377%	-0,0034%	0,1577%	0,35%	102.201.246,43	22
38		BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,3505	0,4099%	-0,0272%	1,2364%	2,00%	108.960.613,98	22
39		SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	-0,4221	0,7218%	-0,0131%	0,4891%	0,50%	235.372.731,04	22
MÉDIA:			-0,0584	0,9157%	-0,0044%	1,3878%		649.101.932,38	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	13,2332%	0,0567	0,0082%	2,3056%	2,50%	63.432.046,20	253
2	ITAU HEDGE MULT FI	12,6602%	0,0412	0,0062%	2,4025%	2,00%	253.672.391,71	253
3	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	12,0254%	0,0285	0,0040%	2,2274%	2,00%	1.470.861.404,56	253
4	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	11,8494%	0,0294	0,0033%	1,8006%	1,50%	2.085.373.904,85	253
5	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	11,8396%	0,0293	0,0033%	1,7914%	0,30%	16.153.252,73	253
6	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	11,6752%	0,0329	0,0027%	1,2965%	2,00%	91.981.016,39	253
7	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	11,2780%	0,0201	0,0013%	1,0029%	1,75%	1.990.198.395,70	253
8	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	11,1889%	0,0078	0,0010%	2,0723%	2,50%	76.169.907,23	253
9	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	10,8790%	-0,0053	-0,0002%	0,5006%	0,50%	580.345.989,99	253
10	SIC SCHRODERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	10,8218%	-0,0153	-0,0004%	0,3862%	0,70%	118.572.783,93	253
11	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	10,8029%	-0,0387	-0,0004%	0,1828%	0,35%	102.201.246,43	253
12	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	10,4516%	-0,0268	-0,0017%	0,9954%	2,00%	84.621.037,57	253
13	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	10,1614%	-0,0592	-0,0027%	0,7312%	1,00%	58.274.702,35	253
14	MAG MULT FIF RESP LIM	10,0218%	-0,0833	-0,0032%	0,6178%	0,90%	113.066.544,02	253
15	SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	9,8366%	-0,1231	-0,0039%	0,5041%	0,50%	235.372.731,04	253
16	OCCAM INST FC FI MULT II	9,6974%	-0,0593	-0,0044%	1,1727%	2,00%	129.660.239,20	253
17	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	9,5186%	-0,0397	-0,0050%	1,9907%	0,14%	105.905.769,63	253
18	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	9,5157%	-0,2143	-0,0051%	0,3772%	0,70%	845.030.575,70	253
19	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	9,4692%	-0,0468	-0,0052%	1,7560%	1,50%	73.413.330,87	253
20	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	9,4264%	-0,0440	-0,0053%	1,9183%	0,08%	115.580.603,75	253
21	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	9,1036%	-0,0586	-0,0065%	1,7604%	0,35%	52.137.765,77	253
22	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	9,0954%	-0,0918	-0,0066%	1,1311%	1,00%	341.932.225,45	253
23	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	9,0227%	-0,1290	-0,0068%	0,8405%	1,00%	74.744.468,94	253
24	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	8,9256%	-0,2427	-0,0072%	0,4730%	1,00%	139.378.872,28	253
25	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	8,7622%	-0,0627	-0,0077%	1,9513%	1,90%	2.758.140.426,09	253
26	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	8,5296%	-0,0612	-0,0085%	2,2175%	2,50%	118.474.032,09	253
27	SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	8,2535%	-0,0611	-0,0095%	2,4726%	2,00%	249.368.189,84	253
28	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	8,2466%	-0,2305	-0,0097%	0,6674%	1,00%	9.212.667.345,12	253
29	MAG STRATEGY FI MULT	7,5945%	-0,1813	-0,0120%	1,0572%	0,85%	98.180.683,65	253
30	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	7,5718%	-0,1247	-0,0121%	1,5402%	0,96%	942.162.728,12	253
31	SAFRA FERMAT FC FI MULT	7,5648%	-0,0913	-0,0121%	2,0980%	2,00%	62.406.775,33	253
32	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	7,5394%	-0,1442	-0,0122%	1,3470%	1,50%	176.349.279,58	253
33	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	7,4192%	-0,0866	-0,0126%	2,3095%	0,50%	140.491.612,66	253
34	FOF FRG FC FI MULT	6,7035%	-0,1066	-0,0152%	2,2699%	0,00%	576.559.958,09	253

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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		BB MULT LP EMPRESA FC	6,3917%	-0,1398	-0,0164%	1,8656%	1,00%	115.124.068,96	253
36		AZ QUEST MULT FC FI MULT	5,7105%	-0,1618	-0,0190%	1,8635%	2,50%	79.241.587,03	253
37		OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	5,6790%	-0,1320	-0,0191%	2,2922%	2,00%	659.465.559,88	253
38		BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	5,3683%	-0,1575	-0,0202%	2,0413%	2,00%	108.960.613,98	253
39		BB MULT MACRO LP FC	3,3710%	-0,1788	-0,0278%	2,4663%	1,50%	799.301.296,00	253
		MÉDIA:	9,1591%	-0,0757	-0,0064%	1,5050%		649.101.932,38	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025
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 GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	4,4390%	0,1823	0,0262%	2,2732%	2,00%	1.470.861.404,56	62
2	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	4,0561%	0,1670	0,0203%	1,9161%	1,50%	2.085.373.904,85	62
3	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	4,0480%	0,1667	0,0201%	1,9071%	0,30%	16.153.252,73	62
4	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	3,8352%	0,1016	0,0169%	2,6355%	2,50%	118.474.032,09	62
5	ITAU HEDGE MULT FI	3,7007%	0,0773	0,0148%	3,0480%	2,00%	253.672.391,71	62
6	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	3,6659%	0,0819	0,0143%	2,7672%	1,50%	73.413.330,87	62
7	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	3,5121%	0,0850	0,0118%	2,2029%	2,50%	63.432.046,20	62
8	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	3,4734%	0,0775	0,0112%	2,2923%	0,14%	105.905.769,63	62
9	OCCAM INST FC FI MULT II	3,1158%	0,0556	0,0056%	1,5893%	2,00%	129.660.239,20	62
10	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	3,0860%	0,0352	0,0052%	2,3321%	0,08%	115.580.603,75	62
11	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	3,0722%	0,1005	0,0049%	0,7650%	0,50%	580.345.989,99	62
12	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	3,0517%	0,0588	0,0046%	1,2265%	2,00%	91.981.016,39	62
13	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	2,8757%	0,0529	0,0018%	0,5369%	1,75%	1.990.198.395,70	62
14	SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	2,7908%	0,0094	0,0005%	0,7630%	0,50%	235.372.731,04	62
15	FOF FRG FC FI MULT	2,7487%	-0,0003	-0,0001%	2,8333%	0,00%	576.559.958,09	62
16	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	2,7392%	-0,0233	-0,0004%	0,2471%	0,35%	102.201.246,43	62
17	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	2,6432%	-0,0249	-0,0018%	1,1754%	1,00%	74.744.468,94	62
18	MAG MULT FIF RESP LIM	2,6245%	-0,2533	-0,0022%	0,1394%	0,90%	113.066.544,02	62
19	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	2,6073%	-0,0411	-0,0024%	0,9382%	2,00%	84.621.037,57	62
20	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	2,5909%	-0,3625	-0,0027%	0,1201%	0,70%	845.030.575,70	62
21	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	2,5494%	-0,0217	-0,0032%	2,3636%	0,50%	140.491.612,66	62
22	VINCI MULTIESTRATEGIA FI MULT	2,5429%	-0,5949	-0,0035%	0,0988%	1,00%	139.378.872,28	62
23	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	2,5331%	-0,1053	-0,0036%	0,5451%	0,70%	118.572.783,93	62
24	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	2,5173%	-0,0231	-0,0037%	2,5611%	2,50%	76.169.907,23	62
25	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	2,4666%	-0,0436	-0,0046%	1,6739%	1,50%	176.349.279,58	62
26	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	2,3491%	-0,0773	-0,0065%	1,3281%	0,96%	942.162.728,12	62
27	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	2,3394%	-0,2373	-0,0067%	0,4535%	1,00%	58.274.702,35	62
28	MAG STRATEGY FI MULT	2,2925%	-0,1055	-0,0074%	1,1161%	0,85%	98.180.683,65	62
29	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	2,2676%	-0,0583	-0,0077%	2,0948%	2,00%	659.465.559,88	62
30	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	2,2429%	-0,0590	-0,0081%	2,1698%	1,90%	2.758.140.426,09	62
31	AZ QUEST MULT FC FI MULT	2,1511%	-0,1088	-0,0096%	1,4031%	2,50%	79.241.587,03	62
32	SAFRA FERMAT FC FI MULT	2,1370%	-0,0408	-0,0096%	3,7193%	2,00%	62.406.775,33	62
33	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	2,1130%	-0,3623	-0,0102%	0,4530%	1,00%	9.212.667.345,12	62
34	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	2,0801%	-0,0663	-0,0106%	2,5501%	0,35%	52.137.765,77	62

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025
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		BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	1,9071%	-0,1320	-0,0134%	1,6228%	2,00%	108.960.613,98	62
36		ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	1,2672%	-0,2429	-0,0236%	1,5445%	1,00%	341.932.225,45	62
37		BB MULT LP EMPRESA FC	0,5792%	-0,3102	-0,0346%	1,7785%	1,00%	115.124.068,96	62
38		SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	0,3825%	-0,2290	-0,0377%	2,6128%	2,00%	249.368.189,84	62
39		BB MULT MACRO LP FC	0,1621%	-0,3362	-0,0413%	1,9578%	1,50%	799.301.296,00	62
		MÉDIA:	2,6040%	-0,0669	-0,0025%	1,6347%		649.101.932,38	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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	2,5746%	0,4416	0,0699%	2,5187%	2,00%	253.672.391,71	22
2	ALPHA FIC FI MULTIMERCADO	2,0692%	0,2214	0,0475%	3,4085%	0,35%	52.137.765,77	22
3	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	1,2920%	0,1767	0,0126%	1,1242%	2,00%	84.621.037,57	22
4	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	1,2920%	0,0771	0,0127%	2,6036%	2,50%	76.169.907,23	22
5	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	1,2072%	0,3883	0,0087%	0,3565%	0,70%	118.572.783,93	22
6	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	1,2028%	0,1163	0,0086%	1,1653%	1,00%	74.744.468,94	22
7	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	1,1372%	0,0541	0,0056%	1,6543%	1,50%	2.085.373.904,85	22
8	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	1,1363%	0,0540	0,0056%	1,6457%	0,30%	16.153.252,73	22
9	BB MULT LP EMPRESA FC	1,1333%	0,1427	0,0054%	0,6001%	1,00%	115.124.068,96	22
10	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	1,1294%	0,0420	0,0053%	2,0042%	2,00%	1.470.861.404,56	22
11	BB MULT MACRO LP FC	1,0843%	0,0720	0,0032%	0,7065%	1,50%	799.301.296,00	22
12	AZ QUEST MULT FC FI MULT	1,0770%	0,0448	0,0029%	1,0236%	2,50%	79.241.587,03	22
13	MAG MULT FIF RESP LIM	1,0522%	0,3319	0,0018%	0,0819%	0,90%	113.066.544,02	22
14	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	1,0254%	0,0224	0,0005%	0,3907%	1,75%	1.990.198.395,70	22
15	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	1,0247%	0,0096	0,0005%	0,8841%	1,00%	341.932.225,45	22
16	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	1,0114%	-0,0100	-0,0001%	0,1266%	0,70%	845.030.575,70	22
17	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	0,9871%	-0,2583	-0,0012%	0,0719%	1,00%	139.378.872,28	22
18	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	0,9579%	-0,0171	-0,0024%	2,2272%	2,00%	659.465.559,88	22
19	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	0,9427%	-0,2292	-0,0032%	0,2157%	1,00%	9.212.667.345,12	22
20	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	0,9377%	-0,3335	-0,0034%	0,1577%	0,35%	102.201.246,43	22
21	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	0,9357%	-0,0196	-0,0034%	2,7190%	2,50%	118.474.032,09	22
22	MAG STRATEGY FI MULT	0,9221%	-0,0499	-0,0041%	1,3022%	0,85%	98.180.683,65	22
23	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,8977%	-0,2147	-0,0052%	0,3852%	1,00%	58.274.702,35	22
24	SAFRA KEPLER ADVANCED FC FI MULT	0,8921%	-0,0521	-0,0054%	1,6425%	2,00%	249.368.189,84	22
25	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	0,8520%	-0,0715	-0,0072%	1,6062%	0,50%	140.491.612,66	22
26	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,8257%	-0,1713	-0,0084%	0,7769%	2,00%	91.981.016,39	22
27	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	0,8173%	-0,2830	-0,0088%	0,4903%	0,50%	580.345.989,99	22
28	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	0,7818%	-0,0737	-0,0103%	2,2225%	1,50%	176.349.279,58	22
29	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,7377%	-0,1490	-0,0124%	1,3144%	2,50%	63.432.046,20	22
30	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	0,7315%	-0,0979	-0,0126%	2,0497%	0,14%	105.905.769,63	22
31	SAFRA CARTE INSTIT FIF CIC MULT RESP LIM	0,7218%	-0,4221	-0,0131%	0,4891%	0,50%	235.372.731,04	22
32	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	0,6138%	-0,1764	-0,0180%	1,6209%	1,90%	2.758.140.426,09	22
33	OCCAM INST FC FI MULT II	0,5290%	-0,2284	-0,0218%	1,5115%	2,00%	129.660.239,20	22
34	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,5074%	-0,2388	-0,0228%	1,5108%	0,96%	942.162.728,12	22

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/01/2025 A 31/01/2025
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		BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	0,4099%	-0,3505	-0,0272%	1,2364%	2,00%	108.960.613,98	22
36		IAJA FC FI MULT CRED PRIV	0,3903%	-0,2189	-0,0280%	2,0376%	0,08%	115.580.603,75	22
37		XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	0,3384%	-0,2695	-0,0304%	1,7929%	1,50%	73.413.330,87	22
38		FOF FRG FC FI MULT	0,2329%	-0,2380	-0,0352%	2,3496%	0,00%	576.559.958,09	22
39		SAFRA FERMAT FC FI MULT	-0,6987%	-0,2990	-0,0774%	4,1002%	2,00%	62.406.775,33	22
		MÉDIA:	0,9157%	-0,0584	-0,0044%	1,3878%		649.101.932,38	

ReckittPREV

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

Janeiro/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: 4,53257
PATRIMÔNIO: 10.558.123,86

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	55,71%
DÓLAR PTAX	44,29%		

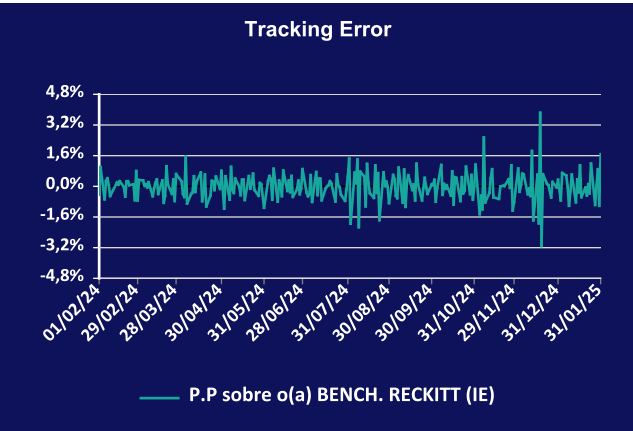
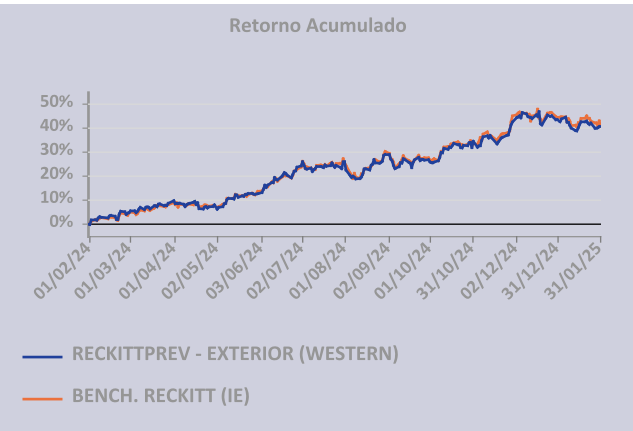
ESTILO: 24,36% | SELEÇÃO: 75,64%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0984%	12° de 36
RETORNO ACUMULADO	40,8972%	12° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	40,8761%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0211%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0071%	23° de 36
BETA	0,6368	14° de 36
MARKET TIMING	5,6593	14° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,4075	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	11,0193%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	86,4970%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,0040	12° de 36
JENSEN	10,6626%	18° de 36
MODIGLIANI	-0,4706%	13° de 36
SHARPE	0,1115	13° de 36
SORTINO	0,1660	14° de 36
TREYNOR	0,0015	18° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,4674	--
DOWNSIDE RISK	0,5932%	21° de 36
RISCO ATIVO	0,7488%	22° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	11,8878%	22° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,6824%	23° de 36
RISCO TOTAL	0,8825%	22° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,0094%	22° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	9
MESES NEGATIVOS	3
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	8
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	4
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	-1,98%	-1,98%	40,90%	71,64%	46,78%	2,29% (31/07/2024)	-3,41% (19/12/2024)
BENCH. RECKITT (IE)	-2,58%	-2,58%	40,88%	62,83%	61,85%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI EUROPE	6,82%	6,82%	6,08%	13,77%	7,17%	2,20% (12/06/2024)	-2,36% (19/12/2024)
MSCI WORLD	3,47%	3,47%	19,69%	37,76%	25,42%	1,76% (22/02/2024)	-3,08% (05/08/2024)
DÓLAR D2	-5,54%	-5,54%	18,18%	14,92%	10,07%	2,36% (23/12/2024)	-2,04% (03/07/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)
EURO PTAX	-5,82%	-5,82%	12,66%	9,44%	0,90%	2,53% (28/11/2024)	-2,22% (06/08/2024)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-2,58%	-2,58%	40,88%	57,50%	36,48%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI WORLD - BRL D2	-2,26%	-2,26%	41,45%	58,31%	38,05%	2,96% (23/12/2024)	-2,98% (05/08/2024)
S&P 500	2,70%	2,70%	24,66%	48,18%	33,77%	2,53% (06/11/2024)	-3,00% (05/08/2024)
S&P 500 BRL PTAX	-3,31%	-3,31%	46,72%	69,41%	45,57%	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: 4,53257
PATRIMÔNIO: 10.558.123,86

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	65,92%
DÓLAR PTAX	34,08%		

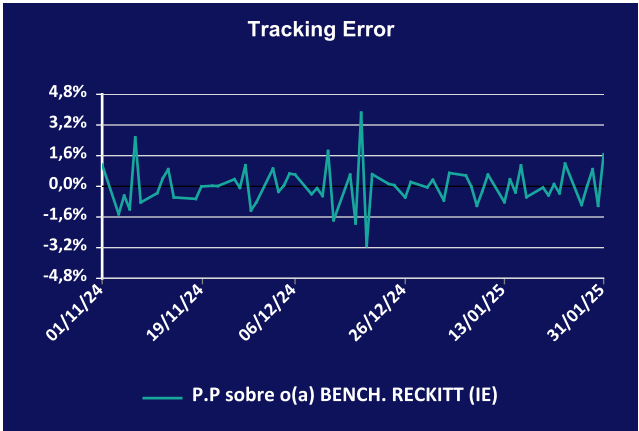
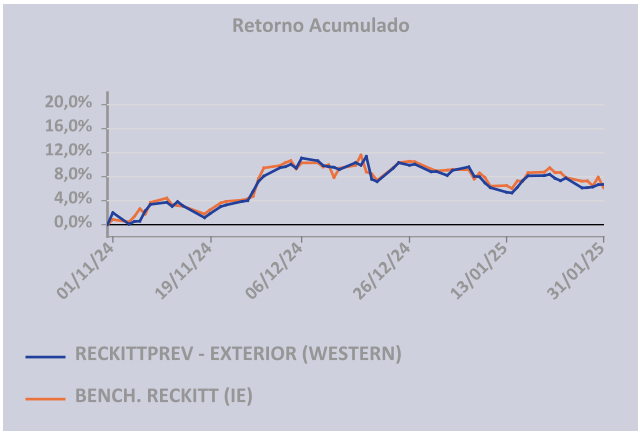
ESTILO: 25,31% | SELEÇÃO: 74,69%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0657%	14° de 36
RETORNO ACUMULADO	6,7076%	14° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	6,1447%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,5629%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,1009%	18° de 36
BETA	0,4256	19° de 36
MARKET TIMING	13,9165	20° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,2449	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	53,6597%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9669%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	92,5643%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,1259	14° de 36
JENSEN	2,4491%	11° de 36
MODIGLIANI	0,6292%	12° de 36
SHARPE	0,0656	12° de 36
SORTINO	0,0922	16° de 36
TREYNOR	0,0014	13° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,3743	--
DOWNSIDE RISK	0,7125%	21° de 36
RISCO ATIVO	1,0583%	24° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	16,8007%	24° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,8934%	24° de 36
RISCO TOTAL	1,0003%	25° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	15,8803%	25° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	8,0979%(11/2024)
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	-1,98%	-1,98%	40,90%	71,64%	46,78%	2,09% (23/12/2024)	-3,41% (19/12/2024)
BENCH. RECKITT (IE)	-2,58%	-2,58%	40,88%	62,83%	61,85%	2,80% (28/11/2024)	-2,50% (18/12/2024)
MSCI EUROPE	6,82%	6,82%	6,08%	13,77%	7,17%	1,99% (06/01/2025)	-2,36% (19/12/2024)
MSCI WORLD	3,47%	3,47%	19,69%	37,76%	25,42%	1,68% (15/01/2025)	-2,40% (18/12/2024)
DÓLAR D2	-5,54%	-5,54%	18,18%	14,92%	10,07%	2,36% (23/12/2024)	-1,62% (19/12/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,78% (07/11/2024)
EURO PTAX	-5,82%	-5,82%	12,66%	9,44%	0,90%	2,53% (28/11/2024)	-1,84% (06/11/2024)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-2,58%	-2,58%	40,88%	57,50%	36,48%	2,80% (28/11/2024)	-2,50% (18/12/2024)
MSCI WORLD - BRL D2	-2,26%	-2,26%	41,45%	58,31%	38,05%	2,96% (23/12/2024)	-2,27% (19/12/2024)
S&P 500	2,70%	2,70%	24,66%	48,18%	33,77%	2,53% (06/11/2024)	-2,95% (18/12/2024)
S&P 500 BRL PTAX	-3,31%	-3,31%	46,72%	69,41%	45,57%	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: 4,53257
PATRIMÔNIO: 10.558.123,86

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	81,55%
DÓLAR PTAX	18,45%		

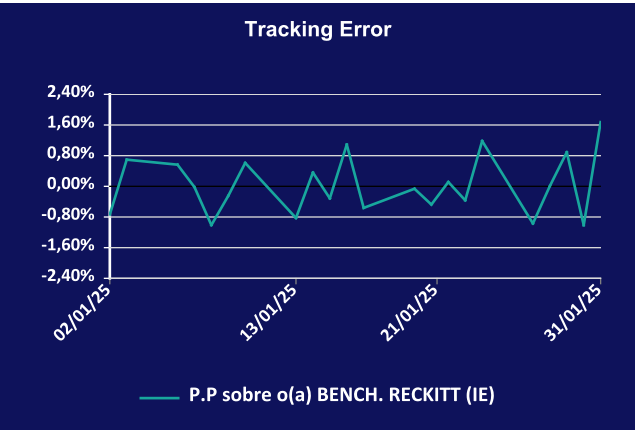
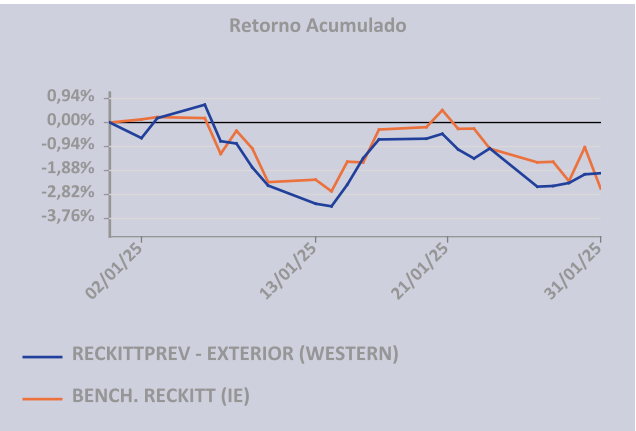
ESTILO: 63,97% | SELEÇÃO: 36,03%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1344%	21° de 36
RETORNO ACUMULADO	-1,9831%	21° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	-2,5801%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,5969%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0912%	11° de 36
BETA	0,4469	17° de 36
MARKET TIMING	4,0393	30° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,2743	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	37,9273%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	98,4180%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	18,2044%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,5492	21° de 36
JENSEN	-1,4231%	19° de 36
MODIGLIANI	0,0218%	23° de 36
SHARPE	-0,1888	23° de 36
SORTINO	-0,2255	21° de 36
TREYNOR	-0,0030	26° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,0173	--
DOWNSIDE RISK	0,5958%	22° de 36
RISCO ATIVO	0,7723%	22° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	12,2612%	22° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,6073%	23° de 36
RISCO TOTAL	0,7120%	27° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	11,3029%	27° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	-1,9831%(01/2025)
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	-1,98%	-1,98%	40,90%	71,64%	46,78%	1,06% (16/01/2025)	-1,51% (27/01/2025)
BENCH. RECKITT (IE)	-2,58%	-2,58%	40,88%	62,83%	61,85%	1,36% (30/01/2025)	-1,63% (31/01/2025)
MSCI EUROPE	6,82%	6,82%	6,08%	13,77%	7,17%	1,99% (06/01/2025)	-1,33% (10/01/2025)
MSCI WORLD	3,47%	3,47%	19,69%	37,76%	25,42%	1,68% (15/01/2025)	-1,44% (10/01/2025)
DÓLAR D2	-5,54%	-5,54%	18,18%	14,92%	10,07%	0,79% (10/01/2025)	-1,49% (22/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	0,95% (08/01/2025)	-1,27% (22/01/2025)
EURO PTAX	-5,82%	-5,82%	12,66%	9,44%	0,90%	0,81% (30/01/2025)	-1,53% (31/01/2025)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-2,58%	-2,58%	40,88%	57,50%	36,48%	1,36% (30/01/2025)	-1,63% (31/01/2025)
MSCI WORLD - BRL D2	-2,26%	-2,26%	41,45%	58,31%	38,05%	1,25% (15/01/2025)	-1,10% (07/01/2025)
S&P 500	2,70%	2,70%	24,66%	48,18%	33,77%	1,83% (15/01/2025)	-1,54% (10/01/2025)
S&P 500 BRL PTAX	-3,31%	-3,31%	46,72%	69,41%	45,57%	1,48% (17/01/2025)	-2,11% (10/01/2025)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025

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	1,3753	0,5853	98,6233%	27,6870%	0,24%	30.771.595,37	253
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	0,6134	0,4335	57,5027%	18,9599%	0,20%	954.213.817,03	253
3	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	0,2973	0,7490	45,2360%	14,5070%	0,06%	134.872.230,41	253
4	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,2906	0,7319	45,2003%	14,1335%	0,20%	281.602.135,55	253
5	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,1682	0,7319	43,2669%	13,5935%	0,22%	216.143.476,20	253
6	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	0,1672	0,4194	44,4171%	17,4539%	0,08%	586.871.155,76	253
7	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	0,1653	0,5422	43,9909%	14,7368%	0,20%	527.031.057,95	253
8	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	0,1586	0,7415	43,2104%	14,7025%	0,40%	70.030.731,65	253
9	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	0,1230	0,6940	42,7107%	12,7170%	0,00%	230.414.758,04	253
10	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,1121	0,6387	42,7303%	13,2839%	0,07%	361.970.083,93	253
11	BRADESCO GLOBAL FIA IE	0,0154	0,7489	41,1376%	13,4808%	1,25%	220.335.715,51	253
12	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	0,0041	0,6369	40,8973%	14,0094%	0,35%	10.558.123,86	253
13	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-0,0059	0,6027	40,7251%	14,0118%	0,70%	10.470.183,67	253
14	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-0,0088	0,6115	40,6605%	14,0840%	0,70%	55.722.944,69	253
15	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,0361	0,6542	40,4612%	13,1112%	0,50%	13.067.911,19	253
16	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,0648	0,6539	40,0355%	13,1052%	1,00%	745.615.816,92	253
17	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,1070	0,4654	37,8044%	16,4509%	0,08%	1.693.793.680,70	253
18	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-0,1521	0,4594	37,0470%	15,7290%	0,08%	103.668.459,83	253
19	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-0,1756	0,6150	37,5449%	14,5393%	0,70%	4.864.369,34	253
20	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-0,1928	0,4081	35,4755%	16,8210%	0,15%	529.916.005,72	253
21	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,2179	0,2721	33,4577%	18,8534%	0,70%	62.581.448,60	253
22	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,2188	0,2597	34,4362%	16,7886%	0,70%	3.902.052,98	253
23	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,2436	0,2465	34,6009%	15,0870%	0,60%	87.601.423,38	253
24	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,2613	0,4600	36,0054%	13,2114%	1,00%	69.326.123,40	253
25	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-0,2654	0,4764	33,9774%	16,8636%	0,30%	321.880.702,35	253
26	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-0,2689	0,5920	37,0528%	12,4609%	0,55%	231.296.140,55	253
27	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,3910	0,5693	33,3798%	14,7292%	0,15%	101.721.544,37	253
28	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-0,4372	0,7124	35,0094%	13,4849%	0,20%	33.340.607,08	253
29	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,4437	0,4639	32,1392%	13,9087%	0,50%	8.549.506,43	253
30	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-0,5254	0,5538	27,6174%	18,1542%	0,60%	46.099.597,52	253
31	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-0,7105	0,5484	28,3492%	13,5504%	0,00%	22.118.629,43	253
32	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,7195	0,3088	25,3076%	13,8705%	0,08%	137.968.139,06	253
33	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-0,7748	0,8633	29,3277%	15,8904%	0,75%	2.900.256,46	253
34	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,7935	1,0165	27,2442%	18,4231%	0,20%	12.815.635,24	253

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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	-1,0645	0,6470	25,1221%	13,4208%	1,75%	37.879.537,99	253
36		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-1,5724	0,2482	9,4146%	12,9370%	0,30%	5.152.967,12	253
MÉDIA:			-0,1711	0,5656	38,3644%	15,2431%		221.307.460,15	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025

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	2,6777	0,5543	30,6924%	34,0015%	0,24%	30.771.595,37	62
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	1,0704	0,2393	12,5673%	20,1056%	0,20%	954.213.817,03	62
3	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,6019	0,5445	8,4840%	15,5399%	0,20%	281.602.135,55	62
4	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	0,5273	0,3437	8,9716%	19,9970%	0,08%	586.871.155,76	62
5	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	0,4170	0,4552	8,1506%	19,2217%	0,08%	103.668.459,83	62
6	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	0,4146	0,6249	7,6092%	15,8986%	0,06%	134.872.230,41	62
7	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	0,4022	0,3794	8,2545%	20,9000%	0,60%	46.099.597,52	62
8	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	0,2695	0,3601	7,4284%	17,0864%	0,20%	527.031.057,95	62
9	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	0,2465	0,6590	7,1063%	19,6219%	0,70%	4.864.369,34	62
10	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	0,2331	0,5840	6,9937%	14,6385%	0,00%	230.414.758,04	62
11	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	0,1835	0,4085	6,9742%	16,2195%	0,70%	55.722.944,69	62
12	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,1521	0,6027	6,7138%	16,4591%	0,22%	216.143.476,20	62
13	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	0,1295	0,4138	6,7257%	16,1688%	0,70%	10.470.183,67	62
14	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	0,1259	0,4257	6,7077%	15,8803%	0,35%	10.558.123,86	62
15	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	0,0744	0,4620	6,5037%	14,2775%	0,55%	231.296.140,55	62
16	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,0576	0,5059	6,4055%	15,2507%	0,07%	361.970.083,93	62
17	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	0,0452	0,4207	6,3799%	15,2668%	0,00%	22.118.629,43	62
18	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	0,0077	0,3407	6,2051%	15,5305%	1,00%	69.326.123,40	62
19	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,0063	0,5164	6,1781%	14,7171%	0,50%	13.067.911,19	62
20	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-0,0099	0,3206	5,9441%	19,3135%	0,15%	529.916.005,72	62
21	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,0254	0,5160	6,1081%	14,7044%	1,00%	745.615.816,92	62
22	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-0,0396	0,5532	5,8865%	18,0047%	0,40%	70.030.731,65	62
23	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-0,1407	0,4824	5,5619%	15,9161%	1,75%	37.879.537,99	62
24	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-0,2244	0,4827	4,7846%	20,1991%	0,30%	321.880.702,35	62
25	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-0,2409	0,6044	5,3200%	15,5504%	1,25%	220.335.715,51	62
26	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,2477	0,3659	4,8009%	18,0983%	0,15%	101.721.544,37	62
27	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,3623	0,3838	4,0761%	19,3657%	0,08%	1.693.793.680,70	62
28	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-0,4074	0,6616	4,9608%	15,0445%	0,20%	33.340.607,08	62
29	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,4242	0,3890	4,2402%	15,9724%	0,50%	8.549.506,43	62
30	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,4669	0,8228	4,2153%	19,6569%	0,20%	12.815.635,24	62
31	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,6905	0,2659	2,2818%	18,5369%	0,70%	3.902.052,98	62
32	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,7040	0,2872	2,6253%	16,6286%	0,08%	137.968.139,06	62
33	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-0,7269	0,7058	2,7575%	20,1239%	0,75%	2.900.256,46	62
34	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,7470	0,2120	2,4001%	15,8110%	0,60%	87.601.423,38	62

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 01/11/2024 A 31/01/2025
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		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-0,8810	0,3821	2,1604%	16,0512%	0,30%	5.152.967,12	62
36		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,9728	0,2797	0,4385%	20,0329%	0,70%	62.581.448,60	62
MÉDIA:			0,0088	0,4599	6,4893%	17,6609%		221.307.460,15	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	5,7538	0,6636	2,8078%	13,3056%	0,00%	22.118.629,43	22
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	2,6728	0,1431	1,5427%	13,3073%	0,20%	954.213.817,03	22
3	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	2,6262	0,2982	3,0851%	23,0351%	0,24%	30.771.595,37	22
4	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	2,5217	0,3275	0,3891%	10,2578%	0,08%	103.668.459,83	22
5	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	1,9504	0,7529	-0,5462%	15,1339%	0,20%	12.815.635,24	22
6	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	1,8094	0,4257	-0,8858%	8,8146%	0,55%	231.296.140,55	22
7	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	1,6015	0,2439	-0,1777%	13,7826%	0,60%	46.099.597,52	22
8	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	1,3332	0,1271	-0,5396%	12,5483%	0,08%	137.968.139,06	22
9	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	1,1066	0,5198	-1,3980%	12,5408%	1,75%	37.879.537,99	22
10	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	1,0855	0,5908	-1,5293%	12,4550%	0,20%	281.602.135,55	22
11	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	1,0654	0,0533	-0,7412%	14,7383%	0,08%	586.871.155,76	22
12	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	0,9674	0,0825	-1,0141%	13,3074%	0,15%	529.916.005,72	22
13	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	0,9510	0,1761	-1,3470%	9,5106%	1,00%	69.326.123,40	22
14	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	0,8131	0,4240	-1,6586%	11,6502%	0,70%	55.722.944,69	22
15	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	0,7861	0,3953	-1,3867%	15,8559%	0,30%	321.880.702,35	22
16	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	0,6985	0,6509	-1,9273%	12,5779%	0,20%	33.340.607,08	22
17	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	0,6646	0,6081	-2,0358%	10,8083%	0,00%	230.414.758,04	22
18	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	0,6559	0,4489	-1,8564%	11,6268%	0,70%	10.470.183,67	22
19	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	0,6433	0,2841	-1,7786%	9,6506%	0,50%	8.549.506,43	22
20	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	0,6078	0,5692	-2,0089%	11,4954%	0,06%	134.872.230,41	22
21	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	0,5493	0,4470	-1,9831%	11,3030%	0,35%	10.558.123,86	22
22	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	0,5149	0,3506	-1,9292%	12,0852%	0,20%	527.031.057,95	22
23	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	0,4534	0,2235	-1,9564%	11,1298%	0,08%	1.693.793.680,70	22
24	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,3607	0,6472	-2,2450%	12,4288%	0,22%	216.143.476,20	22
25	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	0,3090	0,5392	-2,2799%	10,5877%	0,50%	13.067.911,19	22
26	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	0,2879	0,5381	-2,2985%	10,5652%	1,00%	745.615.816,92	22
27	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	0,2791	0,4921	-2,2907%	10,6677%	0,07%	361.970.083,93	22
28	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	0,2595	0,8197	-2,3011%	19,5601%	0,70%	4.864.369,34	22
29	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-0,1038	--	-2,7685%	14,0717%	0,70%	3.902.052,98	22
30	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,1296	--	-2,7982%	13,3690%	0,60%	87.601.423,38	22
31	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-0,1771	0,6075	-2,7650%	13,7586%	1,25%	220.335.715,51	22
32	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,2739	--	-3,1771%	17,2674%	0,70%	62.581.448,60	22
33	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,5559	0,4167	-3,2679%	13,3828%	0,15%	101.721.544,37	22
34	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-0,9903	0,7612	-3,4382%	13,7486%	0,40%	70.030.731,65	22

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-1,0999	0,3027	-3,9480%	11,5097%	0,30%	5.152.967,12	22
36		MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-1,8612	0,8623	-3,7321%	13,7185%	0,75%	2.900.256,46	22
MÉDIA:			0,7816	0,4043	-1,5607%	12,9321%		221.307.460,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2024 A 31/01/2025
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	98,6233%	69,8562%	0,5853	27,6870%	0,24%	30.771.595,37	253
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	57,5027%	33,3388%	0,4335	18,9599%	0,20%	954.213.817,03	253
3	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	45,2360%	11,5400%	0,7490	14,5070%	0,06%	134.872.230,41	253
4	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	45,2003%	12,3203%	0,7319	14,1335%	0,20%	281.602.135,55	253
5	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	44,4171%	20,8235%	0,4194	17,4539%	0,08%	586.871.155,76	253
6	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	43,9909%	16,4855%	0,5422	14,7368%	0,20%	527.031.057,95	253
7	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	43,2669%	10,4074%	0,7319	13,5935%	0,22%	216.143.476,20	253
8	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	43,2104%	10,1051%	0,7415	14,7025%	0,40%	70.030.731,65	253
9	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	42,7303%	12,5354%	0,6387	13,2839%	0,07%	361.970.083,93	253
10	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	42,7107%	10,9503%	0,6940	12,7170%	0,00%	230.414.758,04	253
11	BRADESCO GLOBAL FIA IE	41,1376%	7,8103%	0,7489	13,4808%	1,25%	220.335.715,51	253
12	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	40,8973%	10,6627%	0,6369	14,0094%	0,35%	10.558.123,86	253
13	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	40,7251%	11,5024%	0,6027	14,0118%	0,70%	10.470.183,67	253
14	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	40,6605%	11,1727%	0,6115	14,0840%	0,70%	55.722.944,69	253
15	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	40,4612%	9,8466%	0,6542	13,1112%	0,50%	13.067.911,19	253
16	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	40,0355%	9,4288%	0,6539	13,1052%	1,00%	745.615.816,92	253
17	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	37,8044%	12,7507%	0,4654	16,4509%	0,08%	1.693.793.680,70	253
18	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	37,5449%	8,2463%	0,6150	14,5393%	0,70%	4.864.369,34	253
19	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	37,0528%	8,1796%	0,5920	12,4609%	0,55%	231.296.140,55	253
20	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	37,0470%	12,2475%	0,4594	15,7290%	0,08%	103.668.459,83	253
21	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	36,0054%	11,1817%	0,4600	13,2114%	1,00%	69.326.123,40	253
22	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	35,4755%	12,2133%	0,4081	16,8210%	0,15%	529.916.005,72	253
23	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	35,0094%	2,3344%	0,7124	13,4849%	0,20%	33.340.607,08	253
24	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	34,6009%	15,9564%	0,2465	15,0870%	0,60%	87.601.423,38	253
25	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	34,4362%	15,3869%	0,2597	16,7886%	0,70%	3.902.052,98	253
26	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	33,9774%	8,6589%	0,4764	16,8636%	0,30%	321.880.702,35	253
27	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	33,4577%	14,1254%	0,2721	18,8534%	0,70%	62.581.448,60	253
28	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	33,3798%	4,9411%	0,5693	14,7292%	0,15%	101.721.544,37	253
29	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	32,1392%	7,2170%	0,4639	13,9087%	0,50%	8.549.506,43	253
30	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	29,3277%	-7,6266%	0,8633	15,8904%	0,75%	2.900.256,46	253
31	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	28,3492%	1,5264%	0,5484	13,5504%	0,00%	22.118.629,43	253
32	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	27,6174%	-0,3268%	0,5538	18,1542%	0,60%	46.099.597,52	253
33	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	27,2442%	-14,3487%	1,0165	18,4231%	0,20%	12.815.635,24	253
34	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	25,3076%	4,9590%	0,3088	13,8705%	0,08%	137.968.139,06	253

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE:

01/02/2024 A 31/01/2025

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		GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	25,1221%	-5,1728%	0,6470	13,4208%	1,75%	37.879.537,99	253
36		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	9,4146%	-9,2598%	0,2482	12,9370%	0,30%	5.152.967,12	253
		MÉDIA:	38,3644%	10,3327%	0,5656	15,2431%		221.307.460,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2024 A 31/01/2025
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	30,6924%	25,9384%	0,5543	34,0015%	0,24%	30.771.595,37	62
2	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	12,5673%	8,9261%	0,2393	20,1056%	0,20%	954.213.817,03	62
3	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	8,9716%	4,9485%	0,3437	19,9970%	0,08%	586.871.155,76	62
4	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	8,4840%	3,8424%	0,5445	15,5399%	0,20%	281.602.135,55	62
5	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	8,2545%	4,1350%	0,3794	20,9000%	0,60%	46.099.597,52	62
6	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	8,1506%	3,7853%	0,4552	19,2217%	0,08%	103.668.459,83	62
7	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	7,6092%	2,6732%	0,6249	15,8986%	0,06%	134.872.230,41	62
8	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	7,4284%	3,3608%	0,3601	17,0864%	0,20%	527.031.057,95	62
9	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	7,1063%	2,1157%	0,6590	19,6219%	0,70%	4.864.369,34	62
10	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	6,9937%	2,2328%	0,5840	14,6385%	0,00%	230.414.758,04	62
11	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	6,9742%	2,7673%	0,4085	16,2195%	0,70%	55.722.944,69	62
12	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	6,7257%	2,5010%	0,4138	16,1688%	0,70%	10.470.183,67	62
13	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	6,7138%	1,8867%	0,6027	16,4591%	0,22%	216.143.476,20	62
14	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	6,7077%	2,4491%	0,4257	15,8803%	0,35%	10.558.123,86	62
15	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	6,5037%	2,1330%	0,4620	14,2775%	0,55%	231.296.140,55	62
16	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	6,4055%	1,8912%	0,5059	15,2507%	0,07%	361.970.083,93	62
17	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	6,3799%	2,2601%	0,4207	15,2668%	0,00%	22.118.629,43	62
18	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	6,2051%	2,2267%	0,3407	15,5305%	1,00%	69.326.123,40	62
19	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	6,1781%	1,6200%	0,5164	14,7171%	0,50%	13.067.911,19	62
20	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	6,1081%	1,5514%	0,5160	14,7044%	1,00%	745.615.816,92	62
21	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	5,9441%	1,9996%	0,3206	19,3135%	0,15%	529.916.005,72	62
22	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	5,8865%	1,2180%	0,5532	18,0047%	0,40%	70.030.731,65	62
23	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	5,5619%	1,1654%	0,4824	15,9161%	1,75%	37.879.537,99	62
24	BRADESCO GLOBAL FIA IE	5,3200%	0,4926%	0,6044	15,5504%	1,25%	220.335.715,51	62
25	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	4,9608%	-0,0841%	0,6616	15,0445%	0,20%	33.340.607,08	62
26	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	4,8009%	0,7010%	0,3659	18,0983%	0,15%	101.721.544,37	62
27	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	4,7846%	0,3104%	0,4827	20,1991%	0,30%	321.880.702,35	62
28	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	4,2402%	0,1005%	0,3890	15,9724%	0,50%	8.549.506,43	62
29	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	4,2153%	-1,3514%	0,8228	19,6569%	0,20%	12.815.635,24	62
30	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	4,0761%	-0,0749%	0,3838	19,3657%	0,08%	1.693.793.680,70	62
31	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	2,7575%	-2,4153%	0,7058	20,1239%	0,75%	2.900.256,46	62
32	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	2,6253%	-1,1893%	0,2872	16,6286%	0,08%	137.968.139,06	62
33	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	2,4001%	-1,1776%	0,2120	15,8110%	0,60%	87.601.423,38	62
34	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	2,2818%	-1,4767%	0,2659	18,5369%	0,70%	3.902.052,98	62

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:01/11/2024 A 31/01/2025

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		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	2,1604%	-1,9377%	0,3821	16,0512%	0,30%	5.152.967,12	62
36		MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	0,4385%	-3,3712%	0,2797	20,0329%	0,70%	62.581.448,60	62
MÉDIA:			6,4893%	2,1154%	0,4599	17,6609%		221.307.460,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/01/2025

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	3,0851%	2,7882%	0,2982	23,0351%	0,24%	30.771.595,37	22
2	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	2,8078%	4,2076%	0,6636	13,3056%	0,00%	22.118.629,43	22
3	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	1,5427%	0,9600%	0,1431	13,3073%	0,20%	954.213.817,03	22
4	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	0,3891%	0,4139%	0,3275	10,2578%	0,08%	103.668.459,83	22
5	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-0,1777%	-0,5242%	0,2439	13,7826%	0,60%	46.099.597,52	22
6	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,5396%	-1,3024%	0,1271	12,5483%	0,08%	137.968.139,06	22
7	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,5462%	1,0206%	0,7529	15,1339%	0,20%	12.815.635,24	22
8	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-0,7412%	-1,8686%	0,0533	14,7383%	0,08%	586.871.155,76	22
9	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-0,8858%	-0,4522%	0,4257	8,8146%	0,55%	231.296.140,55	22
10	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-1,0141%	-1,9942%	0,0825	13,3074%	0,15%	529.916.005,72	22
11	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-1,3470%	-1,8008%	0,1761	9,5106%	1,00%	69.326.123,40	22
12	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-1,3867%	-1,3765%	0,3953	15,8559%	0,30%	321.880.702,35	22
13	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-1,3980%	-0,5717%	0,5198	12,5408%	1,75%	37.879.537,99	22
14	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-1,5293%	-0,4510%	0,5908	12,4550%	0,20%	281.602.135,55	22
15	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-1,6586%	-1,1999%	0,4240	11,6502%	0,70%	55.722.944,69	22
16	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-1,7786%	-1,9905%	0,2841	9,6506%	0,50%	8.549.506,43	22
17	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-1,8564%	-1,3004%	0,4489	11,6268%	0,70%	10.470.183,67	22
18	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-1,9273%	-0,7283%	0,6509	12,5779%	0,20%	33.340.607,08	22
19	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-1,9292%	-1,7728%	0,3506	12,0852%	0,20%	527.031.057,95	22
20	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-1,9564%	-2,3250%	0,2235	11,1298%	0,08%	1.693.793.680,70	22
21	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-1,9831%	-1,4232%	0,4470	11,3030%	0,35%	10.558.123,86	22
22	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-2,0089%	-1,0335%	0,5692	11,4954%	0,06%	134.872.230,41	22
23	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-2,0358%	-0,9204%	0,6081	10,8083%	0,00%	230.414.758,04	22
24	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	-2,2450%	-1,0308%	0,6472	12,4288%	0,22%	216.143.476,20	22
25	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-2,2799%	-1,4406%	0,5392	10,5877%	0,50%	13.067.911,19	22
26	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-2,2907%	-1,5790%	0,4921	10,6677%	0,07%	361.970.083,93	22
27	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-2,2985%	-1,4630%	0,5381	10,5652%	1,00%	745.615.816,92	22
28	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-2,3011%	-0,3825%	0,8197	19,5601%	0,70%	4.864.369,34	22
29	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-2,7650%	-1,5513%	0,6075	13,7586%	1,25%	220.335.715,51	22
30	MAG INC EQUI FC DE FIA IE	-2,7685%	-4,1939%	--	14,0717%	0,70%	3.902.052,98	22
31	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-2,7982%	-4,1572%	--	13,3690%	0,60%	87.601.423,38	22
32	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-3,1771%	-4,9698%	--	17,2674%	0,70%	62.581.448,60	22
33	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-3,2679%	-2,8198%	0,4167	13,3828%	0,15%	101.721.544,37	22
34	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-3,4382%	-1,8104%	0,7612	13,7486%	0,40%	70.030.731,65	22

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE:02/01/2025 A 31/01/2025

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		MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-3,7321%	-1,6122%	0,8623	13,7185%	0,75%	2.900.256,46	22
36		BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-3,9480%	-4,0549%	0,3027	11,5097%	0,30%	5.152.967,12	22
MÉDIA:			-1,5607%	-1,2420%	0,4043	12,9321%		221.307.460,15	

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\$)

pps *portfolio
performance*

ReckittPREV

*Agrupamento: -.-
CONSOLIDADO (Gestão Ativa, Western)*

Janeiro/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: 3,04691
PATRIMÔNIO: 165.351.160,61

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	73,14%	IBX	6,00%
IVBX-2	0,10%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	8,78%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	10,72%	DÓLAR PTAX	1,24%

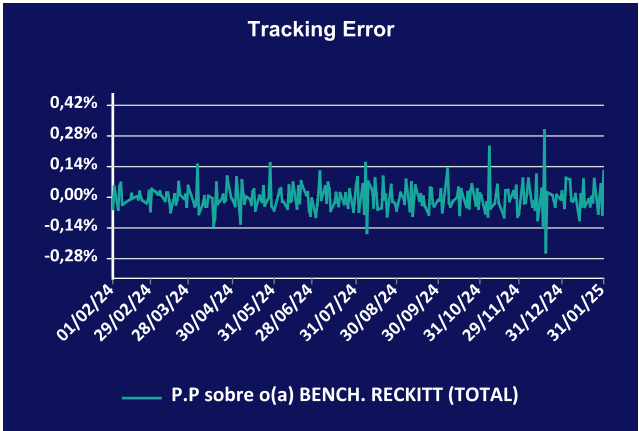
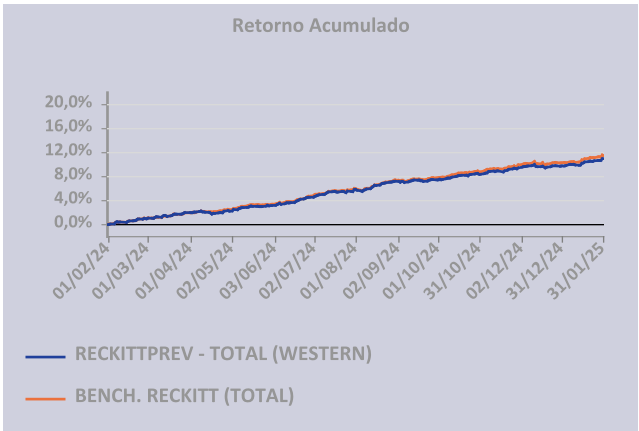
ESTILO: 48,26% | SELEÇÃO: 51,74%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0003%	--
RETORNO ACUMULADO	11,0066%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,4958%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4892%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0029%	--
BETA	0,0652	--
MARKET TIMING	0,0073	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,4262	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	46,7859%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	1,8304%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,4647	--
JENSEN	0,8443%	--
MODIGLIANI	12,5263%	--
SHARPE	0,0037	--
SORTINO	0,0052	--
TREYNOR	0,0000	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,9146	--
DOWNSIDE RISK	0,0607%	--
RISCO ATIVO	0,0594%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9443%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0641%	--
RISCO TOTAL	0,0847%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3453%	--

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	1,11%	1,11%	11,01%	25,98%	34,74%	0,31% (31/07/2024)	-0,27% (12/12/2024)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,08%	1,08%	11,50%	25,85%	39,25%	0,32% (30/01/2025)	-0,43% (18/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	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: 3,04691
PATRIMÔNIO: 165.351.160,61

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	63,71%	IBX	2,64%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	1,49%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	5,36%	IMA B 5+	0,22%
IMA-C	25,95%	DÓLAR PTAX	0,61%

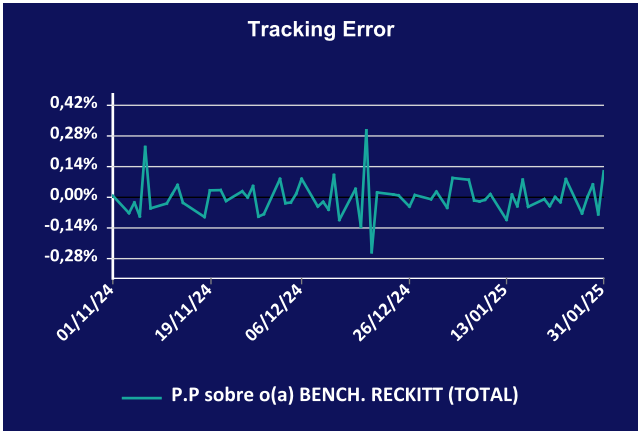
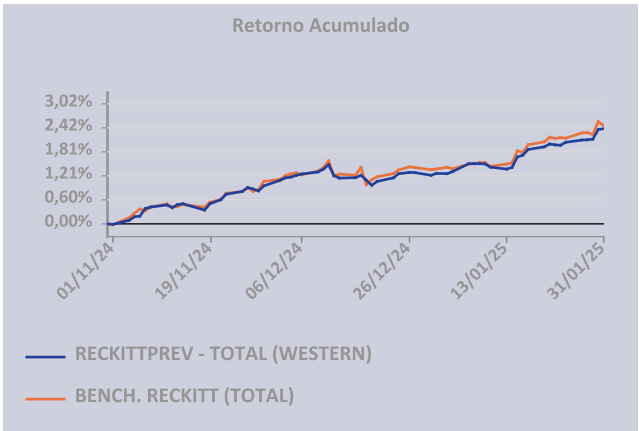
ESTILO: 48,14% | SELEÇÃO: 51,86%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0057%	--
RETORNO ACUMULADO	2,3958%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,4725%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0767%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0029%	--
BETA	0,0492	--
MARKET TIMING	0,0897	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,3878	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	21,7667%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	16,5410%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2432	--
JENSEN	-0,1040%	--
MODIGLIANI	0,6916%	--
SHARPE	-0,0632	--
SORTINO	-0,0825	--
TREYNOR	-0,0011	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,4667	--
DOWNSIDE RISK	0,0694%	--
RISCO ATIVO	0,0807%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,2822%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0706%	--
RISCO TOTAL	0,0903%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4344%	--

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	1,11%	1,11%	11,01%	25,98%	34,74%	0,26% (15/01/2025)	-0,27% (12/12/2024)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,08%	1,08%	11,50%	25,85%	39,25%	0,32% (30/01/2025)	-0,43% (18/12/2024)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,04% (01/11/2024)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,90% (19/12/2024)	-0,69% (18/12/2024)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	2,71% (28/11/2024)	-1,78% (07/11/2024)

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: 3,04691
PATRIMÔNIO: 165.351.160,61

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	77,32%	IBX	1,35%
IVBX-2	0,00%	SMLL	2,58%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	17,54%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,20%	DÓLAR PTAX	0,00%

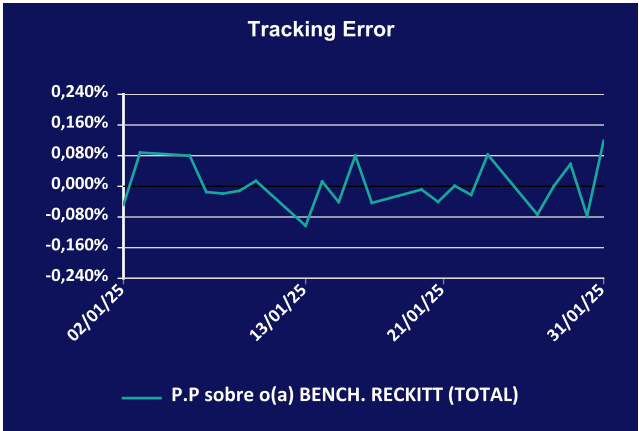
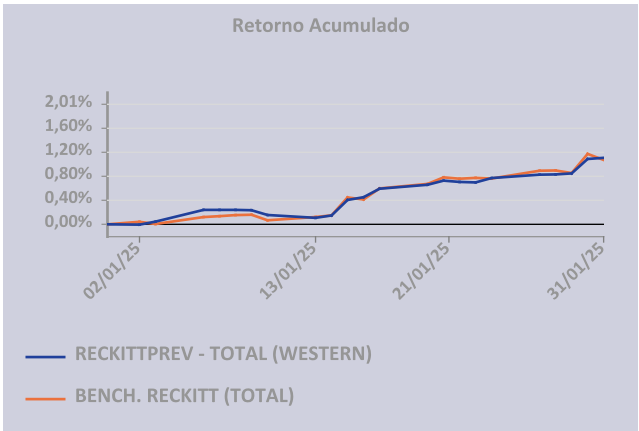
ESTILO: 65,35% | SELEÇÃO: 34,65%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0044%	--
RETORNO ACUMULADO	1,1118%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0764%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0353%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0236%	--
BETA	0,0335	--
MARKET TIMING	1,6828	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,6495	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	88,4849%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	96,6784%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	95,8039%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	0,4144	--
JENSEN	-0,1218%	--
MODIGLIANI	-2,5938%	--
SHARPE	0,0514	--
SORTINO	0,0995	--
TREYNOR	0,0007	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,0160	--
DOWNSIDE RISK	0,0449%	--
RISCO ATIVO	0,0601%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9556%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0577%	--
RISCO TOTAL	0,0873%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3868%	--

PERFIL DE RETORNOS

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



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	1,11%	1,11%	11,01%	25,98%	34,74%	0,26% (15/01/2025)	-0,08% (10/01/2025)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,08%	1,08%	11,50%	25,85%	39,25%	0,32% (30/01/2025)	-0,10% (31/01/2025)
CDI	1,01%	1,01%	10,93%	25,20%	41,26%	0,05% (31/01/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	4,86%	4,86%	-1,27%	11,20%	12,48%	2,82% (30/01/2025)	-1,33% (03/01/2025)
IBX	4,92%	4,92%	-0,80%	10,98%	11,82%	2,83% (30/01/2025)	-1,31% (03/01/2025)
IVBX-2	4,31%	4,31%	-4,29%	3,45%	-9,82%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,11%	6,11%	-14,88%	-9,48%	-23,48%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	3,50%	3,50%	4,45%	20,73%	34,00%	2,38% (27/01/2025)	-1,72% (03/01/2025)
IRF-M	2,58%	2,58%	3,79%	20,72%	32,58%	0,64% (30/01/2025)	-0,26% (16/01/2025)
IMA B 5	1,88%	1,88%	7,43%	19,61%	32,99%	0,61% (30/01/2025)	-0,13% (21/01/2025)
IMA B 5+	0,43%	0,43%	-6,87%	10,86%	14,91%	1,50% (30/01/2025)	-0,64% (17/01/2025)
DÓLAR PTAX	-5,85%	-5,85%	17,70%	14,33%	8,82%	0,95% (08/01/2025)	-1,27% (22/01/2025)