



Avaliação de Performance: RECKITT PREV
Plano de Benefícios

Março/2025

ReckittPREV CONSIDERAÇÕES – AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE (MARÇO DE 2025)

RENTA FIXA

- **CARTEIRA INFLAÇÃO (WESTERN):** Esta carteira é composta, preponderantemente, por títulos públicos que serão mantidos até o vencimento, sendo, portanto, apreçados pela curva do papel. Dessa forma, limitamo-nos a comentar que o rendimento dos últimos doze meses, de 11,7%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 10,5%, 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, pois o retorno acumulado figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto. A desvantagem foi da ordem de 0,5 “basis points”. No entanto, o desempenho mensal nos pareceu favorável. Por fim, 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 março, a atuação da Western à frente desta carteira de renda variável pode ser classificada como razoável. Nota-se que o retorno acumulado, por sinal bastante positivo, não atingiu o IBrX-100 e ocupou o 16º lugar entre 25 possibilidades. Ao mesmo tempo, o risco total, o beta e o risco diversificável situaram-se abaixo da mediana da amostra. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, não se sobressaíram. Neste mês, há indícios de 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 foi bom, dado que o retorno acumulado, mesmo abaixo do CDI, ocupou a 13ª posição entre 37 possíveis. Ao mesmo tempo, o risco total, classificado no agrupamento conservador, nos pareceu mediano, enquanto os índices de Sharpe e de Sortino, medidas de retorno ajustado por risco, se mostraram ligeiramente negativos. O desempenho mensal decepcionou, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS.

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

- **CARTEIRA EXTERIOR (WESTERN):** O histórico dos últimos doze meses desta carteira se mostrou razoável. Nota-se que o retorno acumulado, de 17,7%, figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto, sendo o 18º colocado entre 36 possíveis. Ao mesmo tempo, o risco total ocupou o 20º lugar, enquanto boa parte dos índices de retorno ajustado por risco se mostrou positiva, mas não se sobressaiu. O desempenho mensal deixou bastante a desejar, conforme nos indicam os rankings elaborados pela PPS. No mais, o histórico construído em algumas janelas de longo prazo permaneceu abaixo das expectativas, como, por exemplo, nos últimos trinta e seis meses. Sugere-se, portanto, manter o gestor “em observação”.

ReckittPREV CONSIDERAÇÕES – AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE (MARÇO DE 2025)

CONSOLIDADO

- CARTEIRA CONSOLIDADA - (WESTERN) - Gestão Ativa: O rendimento obtido pela carteira consolidada nos últimos doze meses, de 10,3%, figurou abaixo da variação exibida pelo “benchmark” proposto, de 11,0. Em março, temos um resultado mais modesto, por conta da subtração de valor oriunda da exposição nos multimercados e no exterior. Em tempo, cabe frisar 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 no segmento de renda variável.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – MARÇO DE 2025

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	29.132.485,68	13,55%
Renda Fixa (Ativa)	149.415.831,93	69,50%
Renda Variável	10.140.175,83	4,72%
Estruturado	16.170.242,51	7,52%
Exterior	10.126.965,94	4,71%
Total	214.985.701,89	100,00%

Fonte: PPS

ReckittPREV

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

Março/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: 6,44546
PATRIMÔNIO: 29.132.485,68

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	0,48%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,08%	DÓLAR PTAX	0,00%

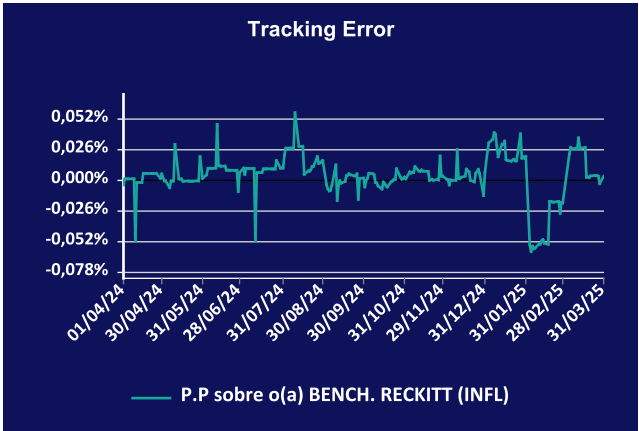
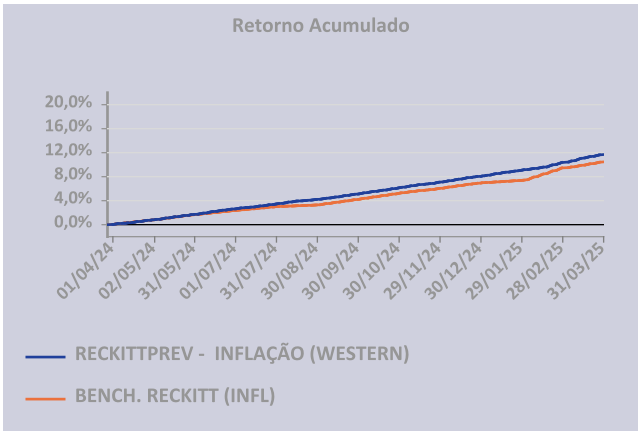
ESTILO: 9,46% | SELEÇÃO: 90,54%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0014%	--
RETORNO ACUMULADO	11,6868%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,4615%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,2253%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1261	--
SORTINO	0,1987	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,6153	--
DOWNSIDE RISK	0,0073%	--
RISCO ATIVO	0,0182%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2904%	--
RISCO TOTAL	0,0128%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2041%	--

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	1,2006%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7362%(08/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,20%	3,31%	11,69%	23,89%	39,05%	0,08% (12/03/2025)	-0,02% (10/07/2024)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,92%	3,25%	10,46%	19,92%	31,41%	0,09% (03/02/2025)	0,01% (01/08/2024)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,07% (03/02/2025)	-0,00% (05/08/2024)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,07% (03/02/2025)	-0,01% (06/08/2024)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	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: 6,44546
PATRIMÔNIO: 29.132.485,68

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	98,18%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,30%	DÓLAR PTAX	0,52%

ESTILO: 7,05%

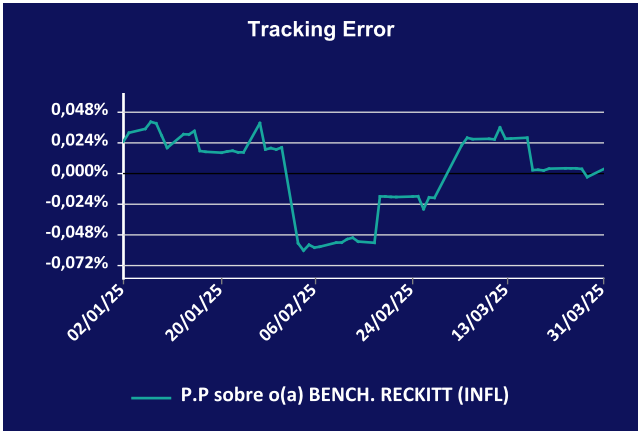
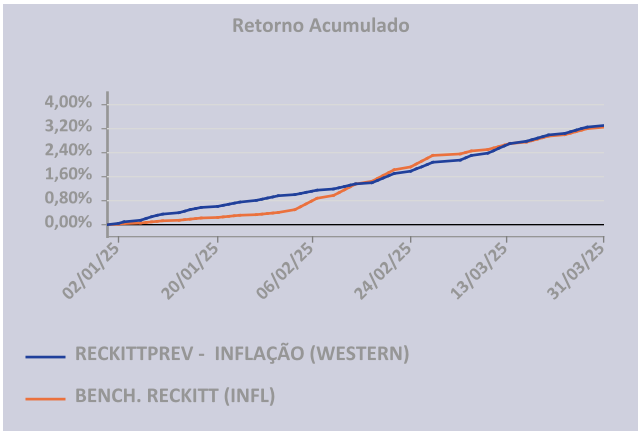
SELEÇÃO: 92,95%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0049%	--
RETORNO ACUMULADO	3,3059%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2492%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0567%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,3266	--
SORTINO	0,8044	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,1661	--
DOWNSIDE RISK	0,0062%	--
RISCO ATIVO	0,0313%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,4982%	--
RISCO TOTAL	0,0157%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2498%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2006%(03/2025)
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	1,20%	3,31%	11,69%	23,89%	39,05%	0,08% (12/03/2025)	0,03% (04/02/2025)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,92%	3,25%	10,46%	19,92%	31,41%	0,09% (03/02/2025)	0,02% (02/01/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/01/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,64% (30/01/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,08% (06/01/2025)	0,04% (05/02/2025)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	1,11% (30/01/2025)	-0,57% (24/02/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,61% (30/01/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-0,93% (24/02/2025)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,43% (30/01/2025)	-0,16% (20/03/2025)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,07% (03/02/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,07% (03/02/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,30% (04/02/2025)

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: 6,44546
PATRIMÔNIO: 29.132.485,68

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	94,11%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	4,13%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	1,76%	DÓLAR PTAX	0,00%

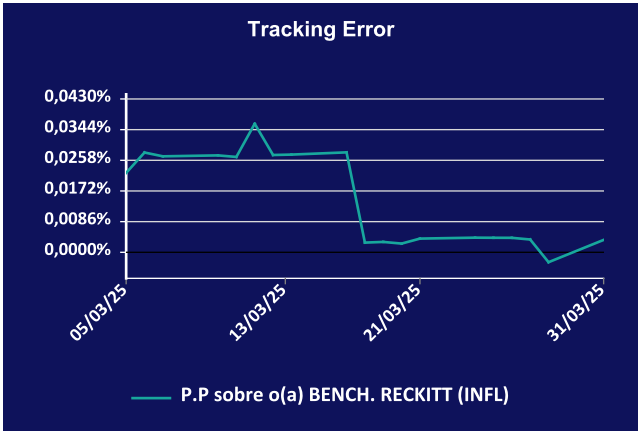
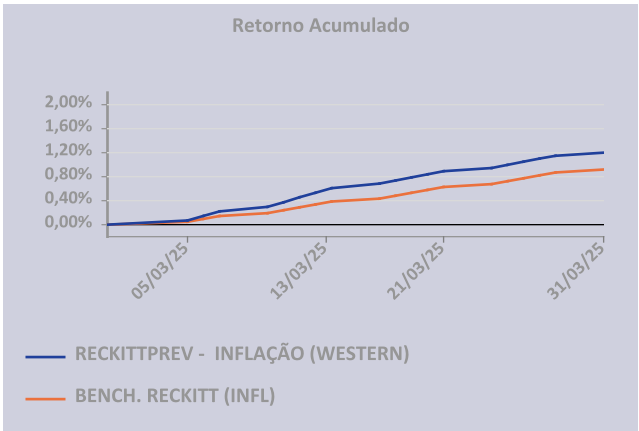
ESTILO: 16,79% | SELEÇÃO: 83,21%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0123%	--
RETORNO ACUMULADO	1,2005%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9194%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,2810%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,8485	--
SORTINO	7,1706	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	1,1371	--
DOWNSIDE RISK	0,0017%	--
RISCO ATIVO	0,0130%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2076%	--
RISCO TOTAL	0,0130%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2076%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2006%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	1,2006%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,20%	3,31%	11,69%	23,89%	39,05%	0,08% (12/03/2025)	0,05% (28/03/2025)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,92%	3,25%	10,46%	19,92%	31,41%	0,05% (05/03/2025)	0,05% (05/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,48% (05/03/2025)	-0,38% (20/03/2025)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,05% (27/03/2025)	0,05% (10/03/2025)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	0,59% (05/03/2025)	-0,41% (20/03/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,23% (11/03/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	0,87% (05/03/2025)	-0,54% (20/03/2025)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,28% (05/03/2025)	-0,16% (20/03/2025)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,03% (05/03/2025)	0,03% (05/03/2025)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,03% (05/03/2025)	0,03% (05/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,22% (14/03/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: -.-
RENTA FIXA*

Março/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: 3,63291
PATRIMÔNIO: 149.415.831,93

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	75,19%	IRF-M	3,81%
IMA B 5	20,73%	IMA B 5+	0,18%
IMA-C	0,09%	DÓLAR PTAX	0,00%

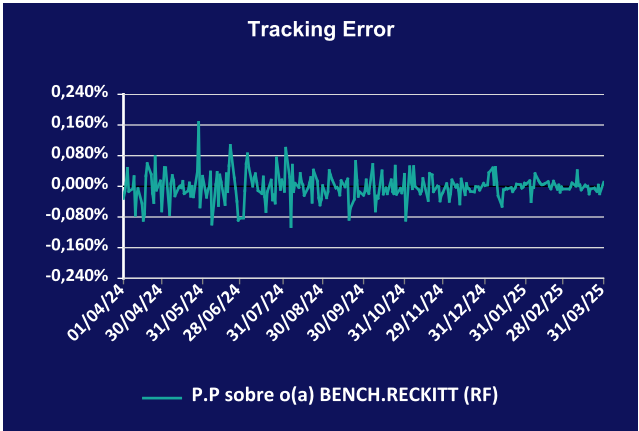
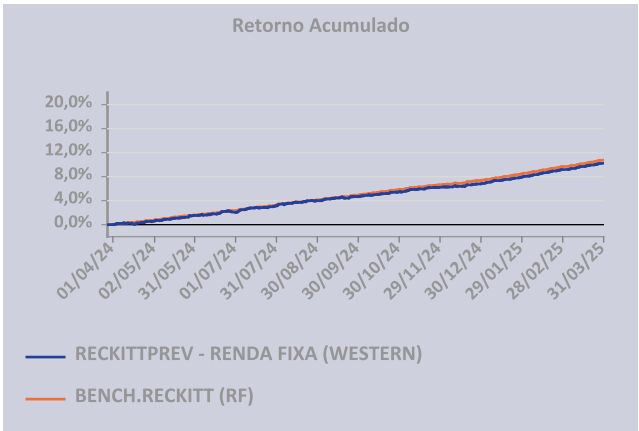
ESTILO: 60,46% | SELEÇÃO: 39,54%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0036%	--
RETORNO ACUMULADO	10,2396%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,7611%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5214%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0756	--
SORTINO	-0,0991	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,8444	--
DOWNSIDE RISK	0,0372%	--
RISCO ATIVO	0,0344%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,5463%	--
RISCO TOTAL	0,0490%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7790%	--

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	0,98%	3,16%	10,24%	25,05%	36,68%	0,21% (28/05/2024)	-0,11% (06/08/2024)
BENCH.RECKITT (RF)	1,00%	3,12%	10,76%	24,10%	40,23%	0,15% (19/12/2024)	-0,05% (12/12/2024)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,04% (27/06/2024)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,08% (06/01/2025)	0,02% (20/12/2024)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	1,11% (30/01/2025)	-1,13% (16/12/2024)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,48% (19/12/2024)	-0,38% (16/12/2024)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,07% (03/02/2025)	-0,00% (05/08/2024)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,07% (03/02/2025)	-0,01% (06/08/2024)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	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: 3,63291
PATRIMÔNIO: 149.415.831,93

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	91,85%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	5,95%	IMA B 5+	0,03%
IMA-C	1,82%	DÓLAR PTAX	0,35%

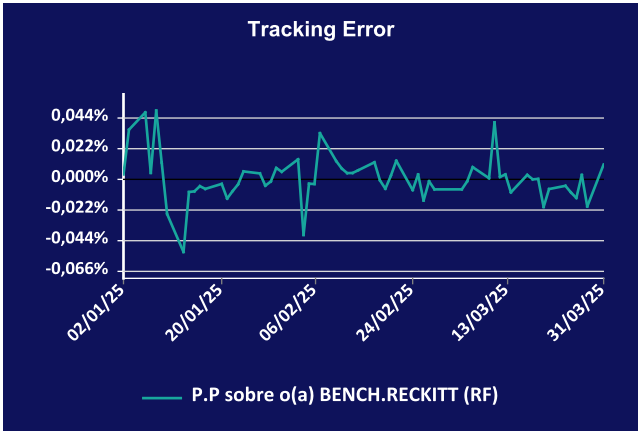
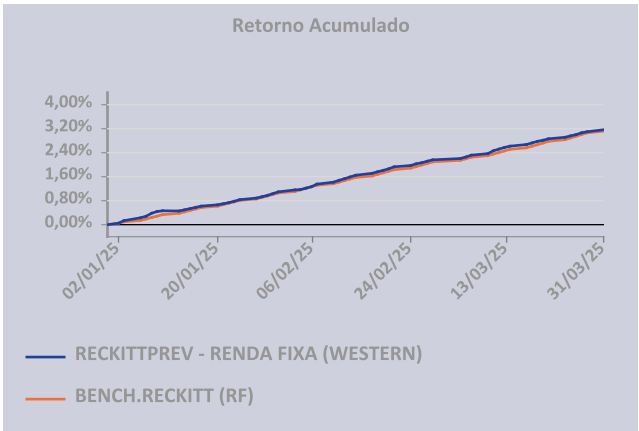
ESTILO: 28,76% | SELEÇÃO: 71,24%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0027%	--
RETORNO ACUMULADO	3,1648%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1163%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,0485%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1619	--
SORTINO	0,2780	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,4165	--
DOWNSIDE RISK	0,0099%	--
RISCO ATIVO	0,0169%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2693%	--
RISCO TOTAL	0,0169%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,2685%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	2
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	1,0933%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9834%(03/2025)



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	0,98%	3,16%	10,24%	25,05%	36,68%	0,10% (08/01/2025)	-0,01% (13/01/2025)
BENCH.RECKITT (RF)	1,00%	3,12%	10,76%	24,10%	40,23%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (29/01/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/01/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,64% (30/01/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,08% (06/01/2025)	0,04% (05/02/2025)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	1,11% (30/01/2025)	-0,57% (24/02/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,61% (30/01/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-0,93% (24/02/2025)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,43% (30/01/2025)	-0,16% (20/03/2025)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,07% (03/02/2025)	0,01% (02/01/2025)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,07% (03/02/2025)	0,00% (02/01/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,30% (04/02/2025)

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: 3,63291
PATRIMÔNIO: 149.415.831,93

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	91,23%	IRF-M	0,84%
IMA B 5	7,20%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,12%	DÓLAR PTAX	0,61%

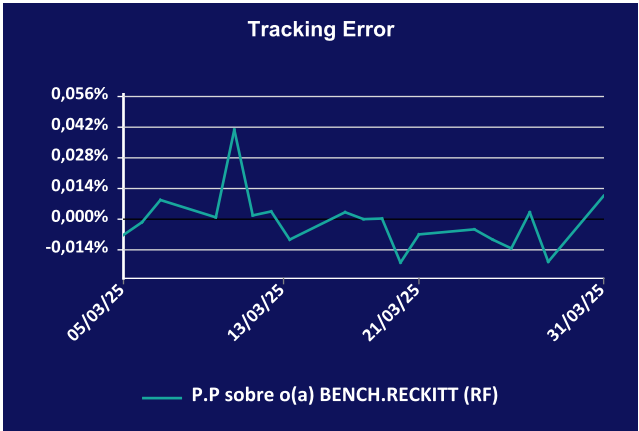
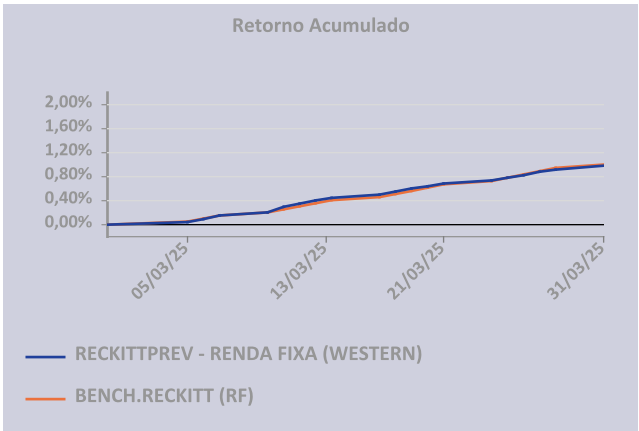
ESTILO: 56,90% | SELEÇÃO: 43,10%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0010%	--
RETORNO ACUMULADO	0,9834%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,0020%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0185%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,0767	--
SORTINO	0,1453	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,8862	--
DOWNSIDE RISK	0,0069%	--
RISCO ATIVO	0,0131%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,2091%	--
RISCO TOTAL	0,0125%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1986%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9834%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9834%(03/2025)



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	0,98%	3,16%	10,24%	25,05%	36,68%	0,09% (11/03/2025)	0,03% (20/03/2025)
BENCH.RECKITT (RF)	1,00%	3,12%	10,76%	24,10%	40,23%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,48% (05/03/2025)	-0,38% (20/03/2025)
IMA-S	0,96%	3,09%	11,54%	25,58%	42,44%	0,05% (27/03/2025)	0,05% (10/03/2025)
IMA-B	1,84%	3,45%	0,75%	12,65%	21,11%	0,59% (05/03/2025)	-0,41% (20/03/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,23% (11/03/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	0,87% (05/03/2025)	-0,54% (20/03/2025)
IMA-GERAL	1,27%	3,50%	7,02%	20,50%	33,54%	0,28% (05/03/2025)	-0,16% (20/03/2025)
IPCA	0,56%	2,04%	5,48%	9,62%	14,72%	0,03% (05/03/2025)	0,03% (05/03/2025)
INPC	0,51%	2,00%	5,20%	8,78%	13,52%	0,03% (05/03/2025)	0,03% (05/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,22% (14/03/2025)

ReckittPREV

*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Março/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: 2,26212
PATRIMÔNIO: 10.140.175,83

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	3,75%	IBX	89,79%
IVBX-2	4,67%	SMLL	1,19%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,59%
IMA-B	0,00%		

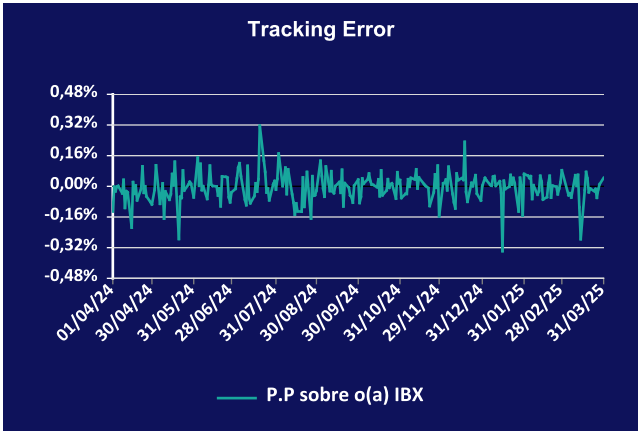
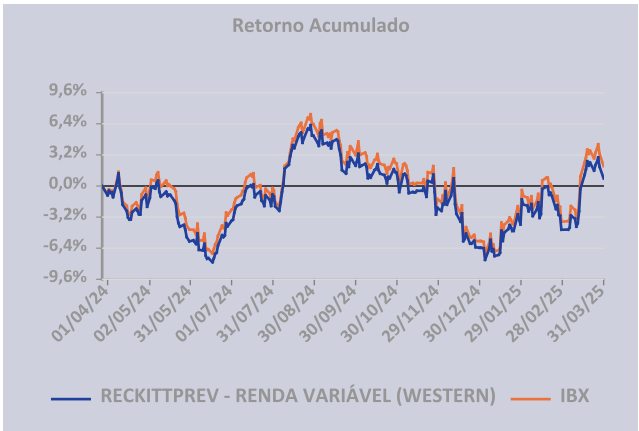
ESTILO: 99,46% | SELEÇÃO: 0,54%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0355%	15° de 25
RETORNO ACUMULADO	0,7727%	15° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,0442%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,2714%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0017%	10° de 25
BETA	0,9647	22° de 25
MARKET TIMING	-0,5800	23° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9938	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	28,1303%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	94,0095%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,1091	16° de 25
JENSEN	-1,5958%	15° de 25
MODIGLIANI	-1,6198%	15° de 25
SHARPE	-0,0415	15° de 25
SORTINO	-0,0568	15° de 25
TREYNOR	-0,0003	15° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,3591	--
DOWNSIDE RISK	0,6251%	20° de 25
RISCO ATIVO	0,0744%	12° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,1815%	12° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0676%	11° de 25
RISCO TOTAL	0,8551%	23° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,5758%	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	5,52%	7,61%	0,77%	24,82%	4,25%	2,68% (30/01/2025)	-2,93% (18/12/2024)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-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: 2,26212
PATRIMÔNIO: 10.140.175,83

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	4,55%	IBX	89,94%
IVBX-2	4,90%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,61%		

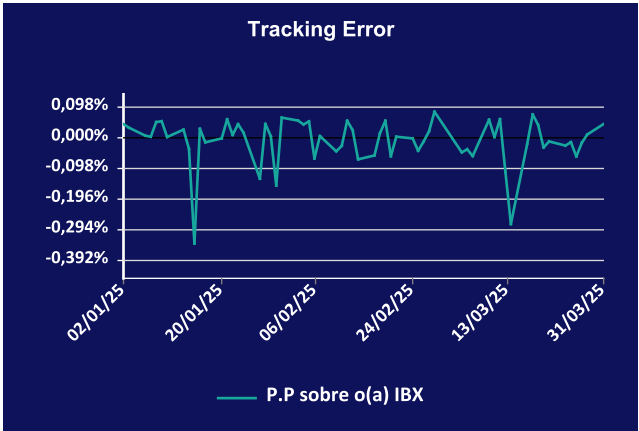
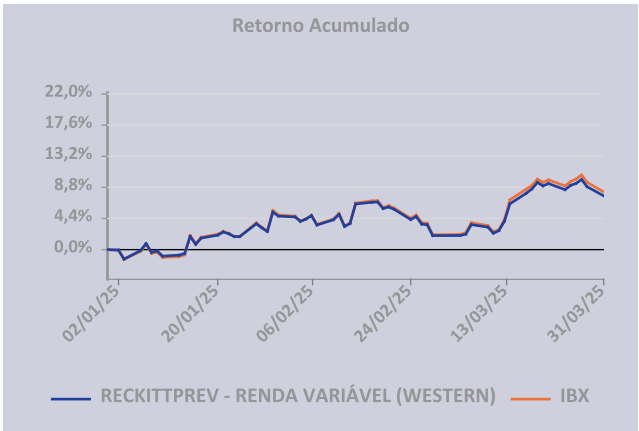
ESTILO: 99,77% | SELEÇÃO: 0,23%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0769%	21° de 25
RETORNO ACUMULADO	7,6074%	21° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	8,1707%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5633%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0120%	3° de 25
BETA	0,9651	21° de 25
MARKET TIMING	-1,6309	24° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9979	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	90,2814%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	99,9915%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,9409	21° de 25
JENSEN	-0,3049%	19° de 25
MODIGLIANI	-0,3274%	19° de 25
SHARPE	0,0761	19° de 25
SORTINO	0,1269	19° de 25
TREYNOR	0,0008	19° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	9,5931	--
DOWNSIDE RISK	0,6059%	22° de 25
RISCO ATIVO	0,0743%	13° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,1798%	13° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0521%	13° de 25
RISCO TOTAL	1,0096%	22° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	16,0269%	22° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	2
MAIOR RETORNO MENSAL	5,5169%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-2,6375%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	5,52%	7,61%	0,77%	24,82%	4,25%	2,68% (30/01/2025)	-1,63% (12/02/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,81% (12/02/2025)

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: 2,26212
PATRIMÔNIO: 10.140.175,83

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	3,66%	IBX	85,18%
IVBX-2	11,15%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA-B	0,00%		

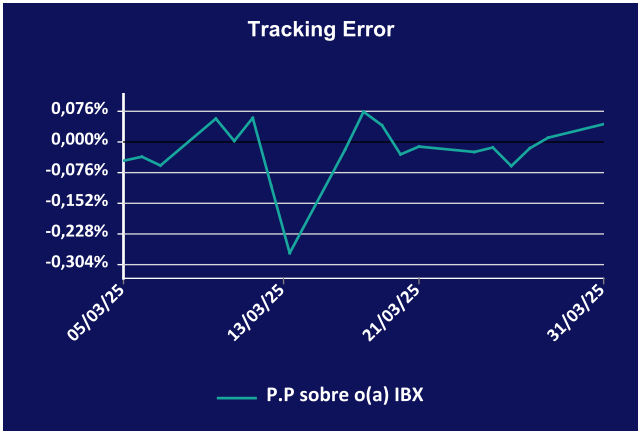
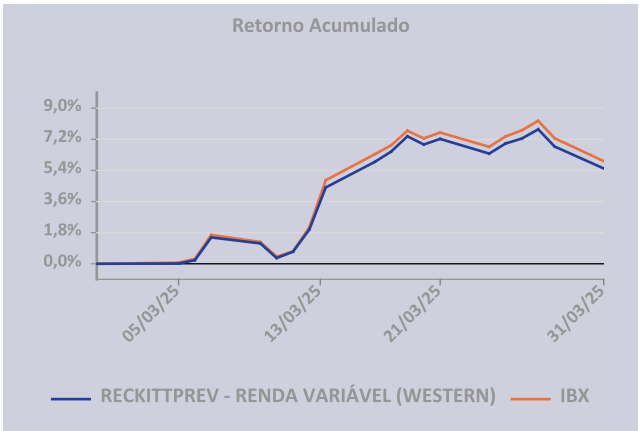
ESTILO: 99,85% | SELEÇÃO: 0,15%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,2365%	16° de 25
RETORNO ACUMULADO	5,5169%	16° de 25
RETORNO DA REFERÊNCIA	5,9414%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4244%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0132%	4° de 25
BETA	0,9777	19° de 25
MARKET TIMING	-3,0422	20° de 25
R^2 DA REGRESSÃO	0,9976	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	67,8183%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	99,6032%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-4,4298	20° de 25
JENSEN	-0,1642%	14° de 25
MODIGLIANI	-0,1830%	13° de 25
SHARPE	0,2566	13° de 25
SORTINO	0,4927	14° de 25
TREYNOR	0,0024	14° de 25
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,4516	--
DOWNSIDE RISK	0,4800%	19° de 25
RISCO ATIVO	0,0774%	13° de 25
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,2299%	13° de 25
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0585%	14° de 25
RISCO TOTAL	0,9207%	20° de 25
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,6161%	20° de 25

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	5,5169%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	5,5169%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	5,52%	7,61%	0,77%	24,82%	4,25%	2,38% (14/03/2025)	-1,19% (31/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,64% (14/03/2025)	-1,25% (31/03/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,66% (14/03/2025)	-1,23% (31/03/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	1,47% (07/03/2025)	-1,40% (24/03/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,13% (14/03/2025)	-1,55% (31/03/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,27% (31/03/2025)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025
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	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,5498%	0,9973	2,6174%	13,9885%	0,10%	409.166.286,14	253
2	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,5492%	0,9952	2,6295%	13,9679%	0,31%	103.067.364,27	253
3	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,5112%	0,9987	2,5668%	14,0079%	0,15%	188.928.258,48	253
4	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,4752%	0,9955	2,5564%	13,9669%	0,09%	279.592.186,12	253
5	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,3881%	0,9950	2,4739%	13,9603%	0,01%	279.629.711,09	253
6	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3278%	0,9988	2,3826%	14,0095%	0,30%	83.940.379,12	253
7	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,2858%	0,9390	2,8736%	13,1739%	0,30%	32.174.807,63	253
8	COMSHELL CONCHA FIA	0,2322%	0,9848	2,4051%	13,8256%	0,17%	60.165.146,75	253
9	FIA VALUE PREV IBRX	0,2201%	0,9940	2,3184%	13,9420%	0,09%	26.563.636,57	253
10	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,1496%	0,9852	2,3259%	13,8223%	0,56%	21.369.788,48	253
11	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-0,0103%	0,9628	2,2947%	13,6305%	0,15%	102.786.930,54	253
12	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,3367%	0,9753	1,9356%	13,6920%	0,50%	35.517.498,95	253
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,6549%	0,9678	1,6945%	13,5932%	0,00%	153.610.875,95	253
14	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,7792%	0,9936	1,3027%	13,9734%	0,90%	167.412.381,22	253
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-1,6198%	0,9647	0,7728%	13,5759%	0,35%	10.140.175,83	253
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,0824%	0,9418	0,5883%	13,2496%	0,75%	26.687.606,73	253
17	IAJA SAM ACOES FI	-3,1269%	0,9932	-1,0849%	14,0287%	0,22%	31.500.349,95	253
18	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-4,5991%	1,0082	-2,7328%	14,2067%	0,70%	11.527.254,69	253
19	IAJA ACOES FC FIA	-4,6534%	0,9839	-2,5671%	13,9837%	0,08%	67.722.841,46	253
20	DAHLIA ACOES FC FIA	-4,9911%	0,9930	-3,8857%	14,9520%	1,85%	70.465.884,82	253
21	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-5,0241%	1,0448	-4,1367%	15,1643%	2,00%	204.701.231,08	253
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-5,1303%	1,0441	-4,2398%	15,1529%	2,00%	524.728.921,79	253
23	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-5,8570%	1,0625	-5,4779%	15,5740%	0,41%	226.640.108,56	253
24	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-6,4466%	1,0631	-6,1236%	15,5659%	0,75%	26.651.186,42	253
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-6,9608%	1,1405	-8,6247%	17,2380%	1,70%	19.059.936,18	253
MÉDIA:		-1,9433%	1,0009	-0,2054%	14,2498%		126.550.029,95	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/03/2025

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	DAHLIA ACOES FC FIA	0,9042%	1,0778	9,6641%	18,4774%	1,85%	70.465.884,82	61
2	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,1640%	1,0002	8,3337%	16,8423%	0,10%	409.166.286,14	61
3	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,1265%	0,9409	7,9783%	15,8329%	0,30%	32.174.807,63	61
4	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,1194%	1,0003	8,2892%	16,8431%	0,15%	188.928.258,48	61
5	FIA VALUE PREV IBRX	0,0939%	0,9915	8,2216%	16,7085%	0,09%	26.563.636,57	61
6	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,0832%	1,0003	8,2540%	16,8460%	0,31%	103.067.364,27	61
7	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0797%	0,9174	7,9112%	15,7590%	0,15%	102.786.930,54	61
8	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0786%	1,0001	8,2473%	16,8393%	0,30%	83.940.379,12	61
9	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,0442%	0,9982	8,2012%	16,8016%	0,09%	279.592.186,12	61
10	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,0244%	0,9980	8,1807%	16,7989%	0,01%	279.629.711,09	61
11	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-0,0062%	1,0831	8,9689%	19,4657%	0,41%	226.640.108,56	61
12	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,0119%	1,0728	8,8655%	19,1499%	0,75%	26.651.186,42	61
13	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0571%	0,9869	8,0614%	16,6741%	0,56%	21.369.788,48	61
14	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1102%	0,9851	8,0429%	16,7870%	0,17%	60.165.146,75	61
15	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,1250%	0,9780	7,9207%	16,4292%	0,50%	35.517.498,95	61
16	IAJA SAM ACOES FI	-0,1268%	0,9712	7,9469%	16,5224%	0,22%	31.500.349,95	61
17	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,1501%	0,9853	7,9495%	16,6075%	0,90%	167.412.381,22	61
18	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,2741%	0,9703	7,7105%	16,2066%	0,00%	153.610.875,95	61
19	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-0,3275%	0,9652	7,6074%	16,0270%	0,35%	10.140.175,83	61
20	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-0,6345%	1,0594	7,9666%	18,4414%	2,00%	204.701.231,08	61
21	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,6380%	1,0551	7,9456%	18,3775%	2,00%	524.728.921,79	61
22	IAJA ACOES FC FIA	-0,7284%	0,9628	7,3319%	16,4278%	0,08%	67.722.841,46	61
23	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,7449%	0,9520	7,1620%	15,8433%	0,75%	26.687.606,73	61
24	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-1,2547%	0,9846	6,9310%	16,9099%	0,70%	11.527.254,69	61
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-1,8887%	1,0735	6,5440%	18,1870%	1,70%	19.059.936,18	61
MÉDIA:		-0,2144%	1,0004	8,0094%	17,0322%		126.550.029,95	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025
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	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0536%	1,0007	5,9940%	15,3882%	0,15%	188.928.258,48	19
2	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0503%	1,0024	5,9958%	15,4036%	0,10%	409.166.286,14	19
3	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	0,0461%	0,9989	5,9850%	15,3839%	0,31%	103.067.364,27	19
4	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0422%	1,0004	5,9816%	15,3849%	0,30%	83.940.379,12	19
5	FIA VALUE PREV IBRX	0,0329%	0,9922	5,9275%	15,2475%	0,09%	26.563.636,57	19
6	BRADESCO FIA SALUBRE	0,0031%	0,9867	5,8547%	15,1137%	0,50%	35.517.498,95	19
7	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,0362%	1,0027	5,9058%	15,3930%	0,09%	279.592.186,12	19
8	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,0463%	1,0028	5,8958%	15,3934%	0,01%	279.629.711,09	19
9	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0579%	0,9834	5,8294%	15,2221%	0,56%	21.369.788,48	19
10	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0756%	0,9632	5,6732%	14,7865%	0,30%	32.174.807,63	19
11	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-0,1280%	1,0055	5,8128%	15,3895%	0,90%	167.412.381,22	19
12	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,1705%	1,0312	6,4185%	17,4648%	1,85%	70.465.884,82	19
13	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	-0,1830%	0,9778	5,5169%	14,6162%	0,35%	10.140.175,83	19
14	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-0,2159%	0,9047	5,4131%	14,3816%	0,15%	102.786.930,54	19
15	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,2988%	0,9888	5,4370%	14,7147%	0,00%	153.610.875,95	19
16	COMSHELL CONCHA FIA	-0,3289%	0,9878	5,8162%	16,0658%	0,17%	60.165.146,75	19
17	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-0,3801%	1,0021	5,4568%	15,0413%	2,00%	204.701.231,08	19
18	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-0,3906%	1,0018	5,4497%	15,0519%	2,00%	524.728.921,79	19
19	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,5505%	0,9769	5,0899%	14,3451%	0,75%	26.687.606,73	19
20	IAJA SAM ACOES FI	-0,6091%	0,9360	5,0416%	14,3670%	0,22%	31.500.349,95	19
21	IAJA ACOES FC FIA	-0,6977%	0,9312	4,9046%	14,1718%	0,08%	67.722.841,46	19
22	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,7586%	0,9458	5,1471%	15,2612%	0,70%	11.527.254,69	19
23	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,9131%	1,0220	5,6598%	17,7827%	0,75%	26.651.186,42	19
24	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,0715%	1,0510	5,6280%	18,3784%	0,41%	226.640.108,56	19
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-1,4988%	1,0308	4,2355%	14,4749%	1,70%	19.059.936,18	19
MÉDIA:		-0,3273%	0,9891	5,6028%	15,3689%		126.550.029,95	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025

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	2,8736%	0,2651%	0,9390	13,1739%	0,30%	32.174.807,63	253
2	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	2,6295%	0,5411%	0,9952	13,9679%	0,31%	103.067.364,27	253
3	SANTANDER FI IBRX ACOES	2,6174%	0,5480%	0,9973	13,9885%	0,10%	409.166.286,14	253
4	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	2,5668%	0,5103%	0,9987	14,0079%	0,15%	188.928.258,48	253
5	BB ECO GOLD FI EM ACOES	2,5564%	0,4702%	0,9955	13,9669%	0,09%	279.592.186,12	253
6	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	2,4739%	0,3834%	0,9950	13,9603%	0,01%	279.629.711,09	253
7	COMSHELL CONCHA FIA	2,4051%	0,2195%	0,9848	13,8256%	0,17%	60.165.146,75	253
8	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	2,3826%	0,3271%	0,9988	14,0095%	0,30%	83.940.379,12	253
9	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	2,3259%	0,1445%	0,9852	13,8223%	0,56%	21.369.788,48	253
10	FIA VALUE PREV IBRX	2,3184%	0,2184%	0,9940	13,9420%	0,09%	26.563.636,57	253
11	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	2,2947%	-0,0904%	0,9628	13,6305%	0,15%	102.786.930,54	253
12	BRADESCO FIA SALUBRE	1,9356%	-0,3377%	0,9753	13,6920%	0,50%	35.517.498,95	253
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	1,6945%	-0,6465%	0,9678	13,5932%	0,00%	153.610.875,95	253
14	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1,3027%	-0,8008%	0,9936	13,9734%	0,90%	167.412.381,22	253
15	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	0,7728%	-1,5958%	0,9647	13,5759%	0,35%	10.140.175,83	253
16	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	0,5883%	-1,9931%	0,9418	13,2496%	0,75%	26.687.606,73	253
17	IAJA SAM ACOES FI	-1,0849%	-3,1918%	0,9932	14,0287%	0,22%	31.500.349,95	253
18	IAJA ACOES FC FIA	-2,5671%	-4,7592%	0,9839	13,9837%	0,08%	67.722.841,46	253
19	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-2,7328%	-4,7025%	1,0082	14,2067%	0,70%	11.527.254,69	253
20	DAHLIA ACOES FC FIA	-3,8857%	-5,9932%	0,9930	14,9520%	1,85%	70.465.884,82	253
21	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-4,1367%	-5,7674%	1,0448	15,1643%	2,00%	204.701.231,08	253
22	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-4,2398%	-5,8762%	1,0441	15,1529%	2,00%	524.728.921,79	253
23	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-5,4779%	-6,9443%	1,0625	15,5740%	0,41%	226.640.108,56	253
24	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-6,1236%	-7,5840%	1,0631	15,5659%	0,75%	26.651.186,42	253
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-8,6247%	-9,3639%	1,1405	17,2380%	1,70%	19.059.936,18	253
MÉDIA:		-0,2054%	-2,2408%	1,0009	14,2498%		126.550.029,95	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE:02/01/2025 A 31/03/2025

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	DAHLIA ACOES FC FIA	9,6641%	1,1384%	1,0778	18,4774%	1,85%	70.465.884,82	61
2	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	8,9689%	0,2483%	1,0831	19,4657%	0,41%	226.640.108,56	61
3	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	8,8655%	0,2421%	1,0728	19,1499%	0,75%	26.651.186,42	61
4	SANTANDER FI IBRX ACOES	8,3337%	0,1641%	1,0002	16,8423%	0,10%	409.166.286,14	61
5	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	8,2892%	0,1194%	1,0003	16,8431%	0,15%	188.928.258,48	61
6	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	8,2540%	0,0833%	1,0003	16,8460%	0,31%	103.067.364,27	61
7	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	8,2473%	0,0786%	1,0001	16,8393%	0,30%	83.940.379,12	61
8	FIA VALUE PREV IBRX	8,2216%	0,0933%	0,9915	16,7085%	0,09%	26.563.636,57	61
9	BB ECO GOLD FI EM ACOES	8,2012%	0,0442%	0,9982	16,8016%	0,09%	279.592.186,12	61
10	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	8,1807%	0,0245%	0,9980	16,7989%	0,01%	279.629.711,09	61
11	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	8,0614%	-0,0557%	0,9869	16,6741%	0,56%	21.369.788,48	61
12	COMSHELL CONCHA FIA	8,0429%	-0,0956%	0,9851	16,7870%	0,17%	60.165.146,75	61
13	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	7,9783%	0,1201%	0,9409	15,8329%	0,30%	32.174.807,63	61
14	OCEANA VALOR FC FI ACOES	7,9666%	-0,5357%	1,0594	18,4414%	2,00%	204.701.231,08	61
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	7,9495%	-0,1431%	0,9853	16,6075%	0,90%	167.412.381,22	61
16	IAJA SAM ACOES FI	7,9469%	-0,0940%	0,9712	16,5224%	0,22%	31.500.349,95	61
17	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	7,9456%	-0,5386%	1,0551	18,3775%	2,00%	524.728.921,79	61
18	BRADESCO FIA SALUBRE	7,9207%	-0,1210%	0,9780	16,4292%	0,50%	35.517.498,95	61
19	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	7,9112%	0,1989%	0,9174	15,7590%	0,15%	102.786.930,54	61
20	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	7,7105%	-0,2591%	0,9703	16,2066%	0,00%	153.610.875,95	61
21	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	7,6074%	-0,3050%	0,9652	16,0270%	0,35%	10.140.175,83	61
22	IAJA ACOES FC FIA	7,3319%	-0,6670%	0,9628	16,4278%	0,08%	67.722.841,46	61
23	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	7,1620%	-0,6907%	0,9520	15,8433%	0,75%	26.687.606,73	61
24	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	6,9310%	-1,2290%	0,9846	16,9099%	0,70%	11.527.254,69	61
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	6,5440%	-1,7818%	1,0735	18,1870%	1,70%	19.059.936,18	61
MÉDIA:		8,0094%	-0,1585%	1,0004	17,0322%		126.550.029,95	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025

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	DAHLIA ACOES FC FIA	6,4185%	-0,0140%	1,0312	17,4648%	1,85%	70.465.884,82	19
2	SANTANDER FI IBRX ACOES	5,9958%	0,0506%	1,0024	15,4036%	0,10%	409.166.286,14	19
3	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	5,9940%	0,0536%	1,0007	15,3882%	0,15%	188.928.258,48	19
4	CITIPREV INSTITUC FIF ACOES RESP LIM	5,9850%	0,0461%	0,9989	15,3839%	0,31%	103.067.364,27	19
5	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	5,9816%	0,0423%	1,0004	15,3849%	0,30%	83.940.379,12	19
6	FIA VALUE PREV IBRX	5,9275%	0,0327%	0,9922	15,2475%	0,09%	26.563.636,57	19
7	BB ECO GOLD FI EM ACOES	5,9058%	-0,0358%	1,0027	15,3930%	0,09%	279.592.186,12	19
8	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	5,8958%	-0,0459%	1,0028	15,3934%	0,01%	279.629.711,09	19
9	BRADESCO FIA SALUBRE	5,8547%	0,0036%	0,9867	15,1137%	0,50%	35.517.498,95	19
10	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	5,8294%	-0,0562%	0,9834	15,2221%	0,56%	21.369.788,48	19
11	COMSHELL CONCHA FIA	5,8162%	-0,2966%	0,9878	16,0658%	0,17%	60.165.146,75	19
12	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	5,8128%	-0,1250%	1,0055	15,3895%	0,90%	167.412.381,22	19
13	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	5,6732%	-0,0719%	0,9632	14,7865%	0,30%	32.174.807,63	19
14	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	5,6598%	-0,7464%	1,0220	17,7827%	0,75%	26.651.186,42	19
15	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	5,6280%	-0,9631%	1,0510	18,3784%	0,41%	226.640.108,56	19
16	RECKITTPREV - RENDA VARIÁVEL (WESTERN)	5,5169%	-0,1642%	0,9778	14,6162%	0,35%	10.140.175,83	19
17	OCEANA VALOR FC FI ACOES	5,4568%	-0,1956%	1,0021	15,0413%	2,00%	204.701.231,08	19
18	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	5,4497%	-0,2078%	1,0018	15,0519%	2,00%	524.728.921,79	19
19	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	5,4370%	-0,2753%	0,9888	14,7147%	0,00%	153.610.875,95	19
20	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	5,4131%	-0,0361%	0,9047	14,3816%	0,15%	102.786.930,54	19
21	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	5,1471%	-0,6967%	0,9458	15,2612%	0,70%	11.527.254,69	19
22	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	5,0899%	-0,4908%	0,9769	14,3451%	0,75%	26.687.606,73	19
23	IAJA SAM ACOES FI	5,0416%	-0,5258%	0,9360	14,3670%	0,22%	31.500.349,95	19
24	IAJA ACOES FC FIA	4,9046%	-0,5979%	0,9312	14,1718%	0,08%	67.722.841,46	19
25	RPS FIC FI ACOES SELECTION	4,2355%	-0,8199%	1,0308	14,4749%	1,70%	19.059.936,18	19
MÉDIA:		5,6028%	-0,2454%	0,9891	15,3689%		126.550.029,95	

ReckittPREV

*Agrupamento: Multimercados
CONSERVADOR*

Março/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: 1,18031
PATRIMÔNIO: 16.170.242,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	96,53%	IBOVESPA	2,61%
IVBX-2	0,86%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

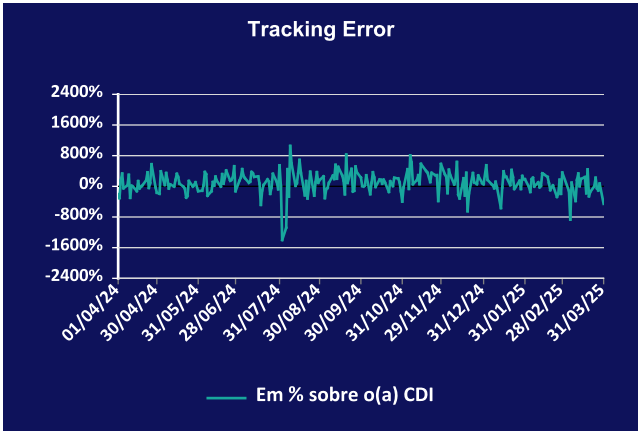
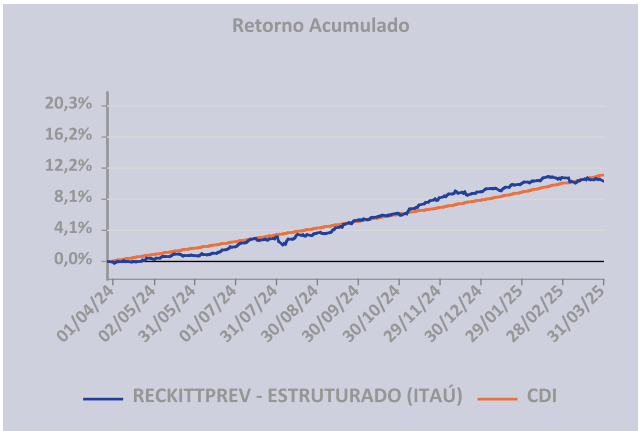
ESTILO: 7,34% | SELEÇÃO: 92,66%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0027%	13° de 37
RETORNO ACUMULADO	10,4753%	13° de 37
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,2766%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	92,8947%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0018	10° de 37
SHARPE	-0,0235	10° de 37
SORTINO	-0,0306	10° de 37
STERLING RATIO	-0,0205	12° de 37
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,5623	--
DOWNSIDE RISK	0,0909%	15° de 37
RISCO ATIVO	281,6142%	18° de 37
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,8793%	15° de 37
RISCO TOTAL	0,1178%	16° de 37
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,8710%	16° de 37

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	11
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO CDI	5
MESES ABAIXO DO CDI	7
MAIOR RETORNO MENSAL	2,0997%(11/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,4232%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,42%	1,24%	10,48%	--	--	0,41% (08/08/2024)	-0,55% (02/08/2024)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	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: 1,18031
PATRIMÔNIO: 16.170.242,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	89,15%	IBOVESPA	0,34%
IVBX-2	0,00%	SMLL	1,76%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	8,74%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

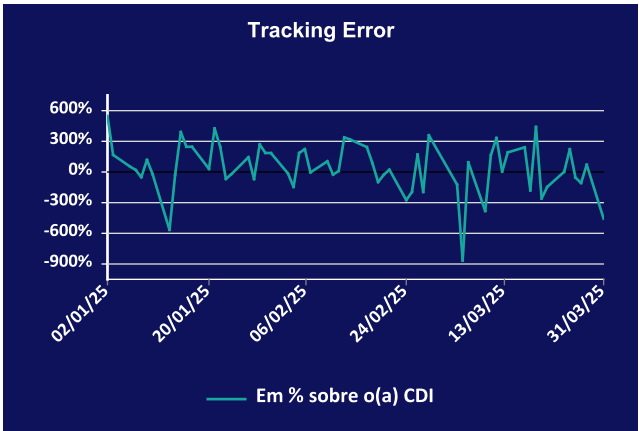
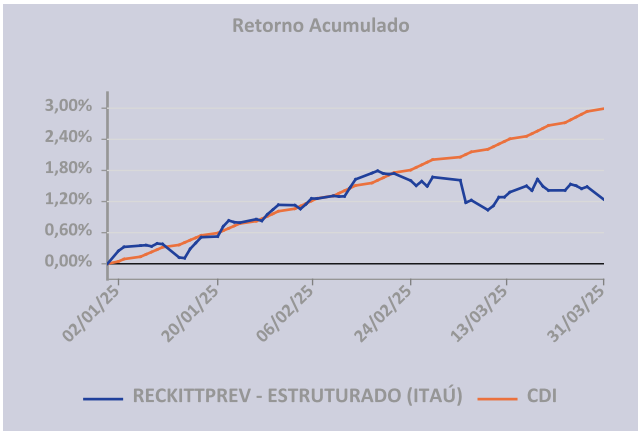
ESTILO: 7,64% | SELEÇÃO: 92,36%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0280%	31° de 37
RETORNO ACUMULADO	1,2426%	31° de 37
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,9919%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	41,5332%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0375	23° de 32
SHARPE	-0,2323	27° de 37
SORTINO	-0,2598	26° de 37
STERLING RATIO	-0,2055	25° de 32
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,8644	--
DOWNSIDE RISK	0,1078%	7° de 37
RISCO ATIVO	248,4457%	11° de 37
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,9142%	11° de 37
RISCO TOTAL	0,1200%	11° de 37
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,9055%	11° de 37

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO CDI	1
MESES ABAIXO DO CDI	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1363%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,4232%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,42%	1,24%	10,48%	--	--	0,25% (02/01/2025)	-0,43% (06/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,81% (12/02/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,64% (30/01/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,61% (30/01/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-0,93% (24/02/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,30% (04/02/2025)

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: 1,18031
PATRIMÔNIO: 16.170.242,51

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	66,43%	IBOVESPA	2,69%
IVBX-2	1,20%	SMLL	3,56%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	20,88%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	5,24%

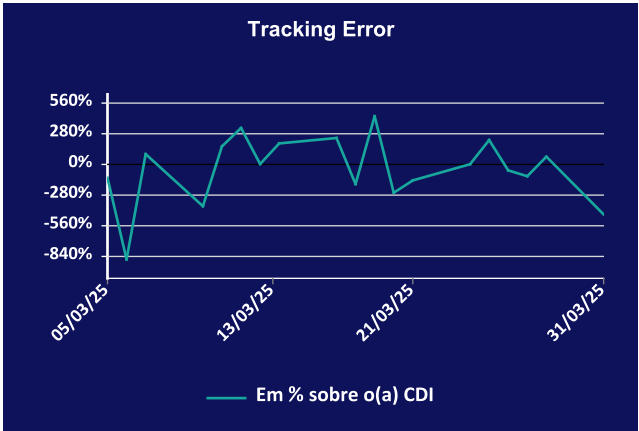
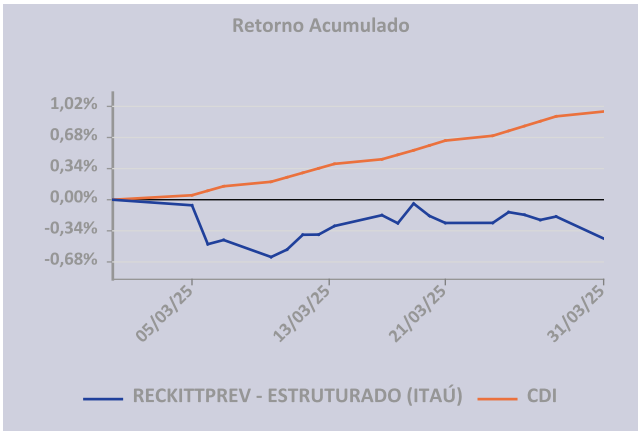
ESTILO: 20,53% | SELEÇÃO: 79,47%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0727%	34° de 37
RETORNO ACUMULADO	-0,4231%	34° de 37
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9640%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM %)	-43,8959%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,1168	24° de 30
SHARPE	-0,4732	34° de 37
SORTINO	-0,4610	34° de 37
STERLING RATIO	-0,3367	24° de 30
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,2923	--
DOWNSIDE RISK	0,1577%	4° de 37
RISCO ATIVO	308,3546%	7° de 37
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,4390%	7° de 37
RISCO TOTAL	0,1533%	7° de 37
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,4347%	7° de 37

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO CDI	0
MESES ABAIXO DO CDI	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-0,4232%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,4232%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: CDI

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,42%	1,24%	10,48%	--	--	0,22% (19/03/2025)	-0,43% (06/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,64% (14/03/2025)	-1,25% (31/03/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,66% (14/03/2025)	-1,23% (31/03/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	1,47% (07/03/2025)	-1,40% (24/03/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,13% (14/03/2025)	-1,55% (31/03/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,27% (31/03/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,48% (05/03/2025)	-0,38% (20/03/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,23% (11/03/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	0,87% (05/03/2025)	-0,54% (20/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,22% (14/03/2025)

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025

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	0,0658	14,0738%	0,0099%	2,3914%	2,50%	60.990.419,52	253
2	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,0426	12,2923%	0,0036%	1,3490%	2,00%	97.827.484,44	253
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,0339	12,4718%	0,0043%	2,0212%	2,50%	53.152.237,53	253
4	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0204	11,6422%	0,0013%	1,0290%	1,75%	2.240.343.395,26	253
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,0037	11,3366%	0,0002%	0,9933%	2,00%	80.996.878,95	253
6	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	-0,0110	10,7583%	-0,0017%	2,4816%	1,90%	318.526.750,14	253
7	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	-0,0143	10,6712%	-0,0021%	2,2939%	2,00%	103.117.328,79	253
8	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,0213	11,1296%	-0,0005%	0,3914%	0,70%	111.761.999,07	253
9	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,0234	10,4762%	-0,0028%	1,8807%	1,50%	1.994.281.993,48	253
10	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,0236	10,4754%	-0,0028%	1,8711%	0,30%	16.170.242,51	253
11	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,0244	10,2474%	-0,0036%	2,3119%	2,00%	1.392.270.562,39	253
12	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	-0,0252	10,1629%	-0,0039%	2,4372%	2,00%	165.555.220,78	253
13	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,0325	10,2598%	-0,0036%	1,7446%	1,50%	67.551.362,60	253
14	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,0339	10,8524%	-0,0015%	0,7054%	1,00%	52.913.758,22	253
15	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	-0,0499	10,3354%	-0,0033%	1,0666%	1,00%	75.464.381,63	253
16	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,0527	10,7613%	-0,0018%	0,5462%	0,50%	527.406.478,82	253
17	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,0739	11,0312%	-0,0009%	0,1889%	0,35%	96.548.348,36	253
18	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,0779	9,6164%	-0,0059%	1,2024%	2,00%	105.900.048,65	253
19	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	-0,0822	9,6110%	-0,0059%	1,1475%	1,00%	353.596.789,86	253
20	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,0828	8,5356%	-0,0098%	1,8724%	0,08%	120.997.228,78	253
21	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,0837	8,3483%	-0,0105%	1,9785%	0,14%	100.458.665,58	253
22	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,0939	10,3651%	-0,0032%	0,5543%	0,90%	112.600.435,49	253
23	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,0978	8,0707%	-0,0115%	1,8607%	1,90%	2.425.279.088,18	253
24	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,1080	7,3719%	-0,0140%	2,0692%	2,00%	105.634.097,75	253
25	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,1085	7,0916%	-0,0151%	2,2009%	0,50%	140.044.468,34	253
26	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,1108	7,1190%	-0,0150%	2,1402%	2,50%	112.118.298,79	253
27	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,1201	8,0430%	-0,0116%	1,5364%	0,96%	829.511.446,97	253
28	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,1240	6,4266%	-0,0175%	2,2422%	2,00%	255.594.491,22	253
29	FOF FRG FC FI MULT	-0,1371	5,3619%	-0,0215%	2,4812%	0,00%	578.083.196,67	253
30	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1393	8,0123%	-0,0117%	1,3395%	1,50%	141.815.484,31	253
31	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1452	6,6212%	-0,0168%	1,8410%	1,00%	107.786.819,43	253
32	MAG STRATEGY FI MULT	-0,1692	7,9266%	-0,0121%	1,1374%	0,85%	99.834.111,48	253
33	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1801	6,0071%	-0,0191%	1,6868%	2,50%	70.494.766,94	253
34	BB MULT MACRO LP FC	-0,1880	3,5227%	-0,0284%	2,4042%	1,50%	718.536.150,38	253

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:01/04/2024 A 31/03/2025

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 JUROS E MOEDAS FC	-0,2230	8,4407%	-0,0102%	0,7335%	1,00%	8.399.082.197,33	253
36	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,2296	10,0279%	-0,0045%	0,3178%	0,70%	822.039.701,94	253
37	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,2515	9,4149%	-0,0067%	0,4283%	1,00%	110.974.317,21	253
	MÉDIA:	-0,0803	9,3219%	-0,0070%	1,5372%		626.088.125,62	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/03/2025

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	SIC SCHRODERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	0,2398	3,2572%	0,0042%	0,2719%	0,70%	111.761.999,07	61
2	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	0,1689	4,8835%	0,0300%	2,8197%	2,00%	103.117.328,79	61
3	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	0,1626	4,4933%	0,0238%	2,3291%	2,00%	165.555.220,78	61
4	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,1542	4,2636%	0,0202%	2,0802%	2,50%	53.152.237,53	61
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,1527	3,5115%	0,0083%	0,8569%	2,00%	80.996.878,95	61
6	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	0,0926	3,2449%	0,0040%	0,6950%	1,00%	353.596.789,86	61
7	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	0,0638	3,4039%	0,0066%	1,6421%	1,00%	75.464.381,63	61
8	MAG MULT FIF RESP LIM	0,0452	3,0036%	0,0002%	0,0643%	0,90%	112.600.435,49	61
9	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,0400	3,0913%	0,0016%	0,6299%	1,75%	2.240.343.395,26	61
10	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	-0,0289	2,7154%	-0,0043%	2,3722%	1,90%	318.526.750,14	61
11	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,0342	2,7833%	-0,0033%	1,5291%	2,00%	105.634.097,75	61
12	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-0,0597	2,8666%	-0,0020%	0,5321%	1,00%	52.913.758,22	61
13	MAG STRATEGY FI MULT	-0,0740	2,6217%	-0,0059%	1,2657%	0,85%	99.834.111,48	61
14	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	-0,0826	2,4135%	-0,0092%	1,7632%	2,50%	60.990.419,52	61
15	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,0863	2,7797%	-0,0034%	0,6280%	1,00%	8.399.082.197,33	61
16	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,0914	2,1482%	-0,0134%	2,3232%	2,00%	255.594.491,22	61
17	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1075	2,2954%	-0,0111%	1,6363%	1,50%	141.815.484,31	61
18	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,1080	2,6994%	-0,0047%	0,6763%	1,00%	107.786.819,43	61
19	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	-0,1144	2,5227%	-0,0075%	1,0372%	2,00%	97.827.484,44	61
20	BB MULT MACRO LP FC	-0,1494	2,5518%	-0,0070%	0,7379%	1,50%	718.536.150,38	61
21	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1847	2,0916%	-0,0144%	1,2270%	2,50%	70.494.766,94	61
22	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,1883	1,9766%	-0,0162%	1,3690%	0,96%	829.511.446,97	61
23	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,2160	2,8909%	-0,0016%	0,1162%	0,70%	822.039.701,94	61
24	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,2208	1,6323%	-0,0217%	1,5607%	1,90%	2.425.279.088,18	61
25	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,2241	1,5743%	-0,0227%	1,6048%	0,50%	140.044.468,34	61
26	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,2322	1,2346%	-0,0282%	1,9157%	1,50%	1.994.281.993,48	61
27	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,2324	1,2426%	-0,0280%	1,9056%	0,30%	16.170.242,51	61
28	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,2398	0,7525%	-0,0359%	2,3706%	2,00%	1.392.270.562,39	61
29	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,2438	0,7170%	-0,0365%	2,3720%	2,50%	112.118.298,79	61
30	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	-0,2450	1,6448%	-0,0216%	1,4007%	1,50%	67.551.362,60	61
31	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,2496	1,6507%	-0,0215%	1,3636%	2,00%	105.900.048,65	61
32	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,2769	0,7789%	-0,0355%	2,0356%	0,14%	100.458.665,58	61
33	FOF FRG FC FI MULT	-0,2789	-0,2833%	-0,0528%	3,0058%	0,00%	578.083.196,67	61
34	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,3107	2,7600%	-0,0037%	0,1848%	0,35%	96.548.348,36	61

SHARPE

PERÍODO DA ANALISE:02/01/2025 A 31/03/2025

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		IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,3150	0,8487%	-0,0344%	1,7345%	0,08%	120.997.228,78	61
36		SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,3564	2,2036%	-0,0126%	0,5538%	0,50%	527.406.478,82	61
37		VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,5587	2,7747%	-0,0035%	0,0908%	1,00%	110.974.317,21	61
MÉDIA:			-0,1186	2,3795%	-0,0098%	1,3703%		626.088.125,62	

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025

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	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	0,2865	1,1344%	0,0089%	0,4812%	1,00%	353.596.789,86	19
2	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	0,2028	1,4176%	0,0237%	1,8430%	2,00%	165.555.220,78	19
3	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	0,1930	1,1322%	0,0088%	0,7102%	1,75%	2.240.343.395,26	19
4	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,1503	1,0606%	0,0050%	0,5260%	1,00%	52.913.758,22	19
5	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	0,1107	1,1843%	0,0115%	1,6544%	2,50%	53.152.237,53	19
6	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	0,0987	1,0445%	0,0042%	0,6793%	2,00%	80.996.878,95	19
7	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	0,0940	1,2874%	0,0170%	2,8586%	2,00%	103.117.328,79	19
8	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	0,0438	1,0838%	0,0063%	2,3036%	1,00%	75.464.381,63	19
9	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	0,0143	0,9831%	0,0010%	1,1327%	1,50%	67.551.362,60	19
10	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	-0,0146	0,9286%	-0,0018%	1,9381%	2,50%	60.990.419,52	19
11	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	-0,0340	0,8722%	-0,0047%	2,1976%	2,00%	105.634.097,75	19
12	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	-0,0380	0,9145%	-0,0026%	1,0825%	1,00%	8.399.082.197,33	19
13	MAG STRATEGY FI MULT	-0,0514	0,8990%	-0,0034%	1,0491%	0,85%	99.834.111,48	19
14	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	-0,0649	0,8722%	-0,0048%	1,1689%	2,00%	97.827.484,44	19
15	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	-0,0712	0,9421%	-0,0011%	0,2475%	0,70%	111.761.999,07	19
16	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	-0,1423	0,7186%	-0,0128%	1,4309%	1,50%	141.815.484,31	19
17	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	-0,1690	0,3824%	-0,0303%	2,8391%	2,00%	255.594.491,22	19
18	AZ QUEST MULT FC FI MULT	-0,1761	0,6079%	-0,0186%	1,6631%	2,50%	70.494.766,94	19
19	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	-0,1800	0,4515%	-0,0267%	2,3732%	1,90%	318.526.750,14	19
20	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	-0,2277	0,4519%	-0,0267%	1,8523%	1,90%	2.425.279.088,18	19
21	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	-0,2426	0,9246%	-0,0021%	0,1338%	0,70%	822.039.701,94	19
22	MAG MULT FIF RESP LIM	-0,2431	0,9512%	-0,0007%	0,0483%	0,90%	112.600.435,49	19
23	BB MULT LP EMPRESA FC	-0,3072	0,7117%	-0,0132%	0,6731%	1,00%	107.786.819,43	19
24	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,3077	0,6441%	-0,0167%	0,8734%	0,96%	829.511.446,97	19
25	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	-0,3241	0,8667%	-0,0051%	0,2376%	0,35%	96.548.348,36	19
26	OCCAM INST FC FI MULT II	-0,3295	0,5104%	-0,0237%	1,1419%	2,00%	105.900.048,65	19
27	FOF FRG FC FI MULT	-0,3323	-0,7284%	-0,0886%	4,2364%	0,00%	578.083.196,67	19
28	BB MULT MACRO LP FC	-0,3581	0,6540%	-0,0162%	0,7103%	1,50%	718.536.150,38	19
29	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	-0,3905	0,6388%	-0,0170%	0,6797%	0,50%	527.406.478,82	19
30	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	-0,4245	0,0460%	-0,0480%	1,7992%	0,50%	140.044.468,34	19
31	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,4526	-0,3651%	-0,0696%	2,4462%	0,14%	100.458.665,58	19
32	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,4725	-0,7701%	-0,0910%	3,0533%	2,00%	1.392.270.562,39	19
33	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,4731	-0,4301%	-0,0731%	2,4478%	1,50%	1.994.281.993,48	19
34	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,4733	-0,4232%	-0,0727%	2,4348%	0,30%	16.170.242,51	19

SHARPE

PERÍODO DA ANÁLISE:05/03/2025 A 31/03/2025

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	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,5161	-0,0410%	-0,0526%	1,6193%	0,08%	120.997.228,78	19
36	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,6059	-0,2450%	-0,0634%	1,6593%	2,50%	112.118.298,79	19
37	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	-0,6936	0,8562%	-0,0056%	0,1210%	1,00%	110.974.317,21	19
	MÉDIA:	-0,1871	0,5992%	-0,0191%	1,4688%		626.088.125,62	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025
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	14,0738%	0,0658	0,0099%	2,3914%	2,50%	60.990.419,52	253
2	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	12,4718%	0,0339	0,0043%	2,0212%	2,50%	53.152.237,53	253
3	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	12,2923%	0,0426	0,0036%	1,3490%	2,00%	97.827.484,44	253
4	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	11,6422%	0,0204	0,0013%	1,0290%	1,75%	2.240.343.395,26	253
5	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	11,3366%	0,0037	0,0002%	0,9933%	2,00%	80.996.878,95	253
6	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	11,1296%	-0,0213	-0,0005%	0,3914%	0,70%	111.761.999,07	253
7	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	11,0312%	-0,0739	-0,0009%	0,1889%	0,35%	96.548.348,36	253
8	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	10,8524%	-0,0339	-0,0015%	0,7054%	1,00%	52.913.758,22	253
9	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	10,7613%	-0,0527	-0,0018%	0,5462%	0,50%	527.406.478,82	253
10	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	10,7583%	-0,0110	-0,0017%	2,4816%	1,90%	318.526.750,14	253
11	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	10,6712%	-0,0143	-0,0021%	2,2939%	2,00%	103.117.328,79	253
12	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	10,4762%	-0,0234	-0,0028%	1,8807%	1,50%	1.994.281.993,48	253
13	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	10,4754%	-0,0236	-0,0028%	1,8711%	0,30%	16.170.242,51	253
14	MAG MULT FIF RESP LIM	10,3651%	-0,0939	-0,0032%	0,5543%	0,90%	112.600.435,49	253
15	DAYCOVAL MULTIESTRATEGIA F I M	10,3354%	-0,0499	-0,0033%	1,0666%	1,00%	75.464.381,63	253
16	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	10,2598%	-0,0325	-0,0036%	1,7446%	1,50%	67.551.362,60	253
17	ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	10,2474%	-0,0244	-0,0036%	2,3119%	2,00%	1.392.270.562,39	253
18	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	10,1629%	-0,0252	-0,0039%	2,4372%	2,00%	165.555.220,78	253
19	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	10,0279%	-0,2296	-0,0045%	0,3178%	0,70%	822.039.701,94	253
20	OCCAM INST FC FI MULT II	9,6164%	-0,0779	-0,0059%	1,2024%	2,00%	105.900.048,65	253
21	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	9,6110%	-0,0822	-0,0059%	1,1475%	1,00%	353.596.789,86	253
22	VINCI MULTIESTRATEGIA FI MULT	9,4149%	-0,2515	-0,0067%	0,4283%	1,00%	110.974.317,21	253
23	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	8,5356%	-0,0828	-0,0098%	1,8724%	0,08%	120.997.228,78	253
24	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	8,4407%	-0,2230	-0,0102%	0,7335%	1,00%	8.399.082.197,33	253
25	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	8,3483%	-0,0837	-0,0105%	1,9785%	0,14%	100.458.665,58	253
26	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	8,0707%	-0,0978	-0,0115%	1,8607%	1,90%	2.425.279.088,18	253
27	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	8,0430%	-0,1201	-0,0116%	1,5364%	0,96%	829.511.446,97	253
28	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	8,0123%	-0,1393	-0,0117%	1,3395%	1,50%	141.815.484,31	253
29	MAG STRATEGY FI MULT	7,9266%	-0,1692	-0,0121%	1,1374%	0,85%	99.834.111,48	253
30	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	7,3719%	-0,1080	-0,0140%	2,0692%	2,00%	105.634.097,75	253
31	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	7,1190%	-0,1108	-0,0150%	2,1402%	2,50%	112.118.298,79	253
32	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	7,0916%	-0,1085	-0,0151%	2,2009%	0,50%	140.044.468,34	253
33	BB MULT LP EMPRESA FC	6,6212%	-0,1452	-0,0168%	1,8410%	1,00%	107.786.819,43	253
34	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	6,4266%	-0,1240	-0,0175%	2,2422%	2,00%	255.594.491,22	253

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025
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	AZ QUEST MULT FC FI MULT		6,0071%	-0,1801	-0,0191%	1,6868%	2,50%	70.494.766,94	253
36	FOF FRG FC FI MULT		5,3619%	-0,1371	-0,0215%	2,4812%	0,00%	578.083.196,67	253
37	BB MULT MACRO LP FC		3,5227%	-0,1880	-0,0284%	2,4042%	1,50%	718.536.150,38	253
	MÉDIA:		9,3219%	-0,0803	-0,0070%	1,5372%		626.088.125,62	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/03/2025

CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL

PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 50.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	4,8835%	0,1689	0,0300%	2,8197%	2,00%	103.117.328,79	61
2	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	4,4933%	0,1626	0,0238%	2,3291%	2,00%	165.555.220,78	61
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	4,2636%	0,1542	0,0202%	2,0802%	2,50%	53.152.237,53	61
4	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	3,5115%	0,1527	0,0083%	0,8569%	2,00%	80.996.878,95	61
5	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	3,4039%	0,0638	0,0066%	1,6421%	1,00%	75.464.381,63	61
6	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	3,2572%	0,2398	0,0042%	0,2719%	0,70%	111.761.999,07	61
7	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	3,2449%	0,0926	0,0040%	0,6950%	1,00%	353.596.789,86	61
8	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	3,0913%	0,0400	0,0016%	0,6299%	1,75%	2.240.343.395,26	61
9	MAG MULT FIF RESP LIM	3,0036%	0,0452	0,0002%	0,0643%	0,90%	112.600.435,49	61
10	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	2,8909%	-0,2160	-0,0016%	0,1162%	0,70%	822.039.701,94	61
11	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	2,8666%	-0,0597	-0,0020%	0,5321%	1,00%	52.913.758,22	61
12	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	2,7833%	-0,0342	-0,0033%	1,5291%	2,00%	105.634.097,75	61
13	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	2,7797%	-0,0863	-0,0034%	0,6280%	1,00%	8.399.082.197,33	61
14	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	2,7747%	-0,5587	-0,0035%	0,0908%	1,00%	110.974.317,21	61
15	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	2,7600%	-0,3107	-0,0037%	0,1848%	0,35%	96.548.348,36	61
16	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	2,7154%	-0,0289	-0,0043%	2,3722%	1,90%	318.526.750,14	61
17	BB MULT LP EMPRESA FC	2,6994%	-0,1080	-0,0047%	0,6763%	1,00%	107.786.819,43	61
18	MAG STRATEGY FI MULT	2,6217%	-0,0740	-0,0059%	1,2657%	0,85%	99.834.111,48	61
19	BB MULT MACRO LP FC	2,5518%	-0,1494	-0,0070%	0,7379%	1,50%	718.536.150,38	61
20	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	2,5227%	-0,1144	-0,0075%	1,0372%	2,00%	97.827.484,44	61
21	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	2,4135%	-0,0826	-0,0092%	1,7632%	2,50%	60.990.419,52	61
22	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	2,2954%	-0,1075	-0,0111%	1,6363%	1,50%	141.815.484,31	61
23	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	2,2036%	-0,3564	-0,0126%	0,5538%	0,50%	527.406.478,82	61
24	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	2,1482%	-0,0914	-0,0134%	2,3232%	2,00%	255.594.491,22	61
25	AZ QUEST MULT FC FI MULT	2,0916%	-0,1847	-0,0144%	1,2270%	2,50%	70.494.766,94	61
26	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	1,9766%	-0,1883	-0,0162%	1,3690%	0,96%	829.511.446,97	61
27	OCCAM INST FC FI MULT II	1,6507%	-0,2496	-0,0215%	1,3636%	2,00%	105.900.048,65	61
28	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	1,6448%	-0,2450	-0,0216%	1,4007%	1,50%	67.551.362,60	61
29	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	1,6323%	-0,2208	-0,0217%	1,5607%	1,90%	2.425.279.088,18	61
30	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	1,5743%	-0,2241	-0,0227%	1,6048%	0,50%	140.044.468,34	61
31	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	1,2426%	-0,2324	-0,0280%	1,9056%	0,30%	16.170.242,51	61
32	ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	1,2346%	-0,2322	-0,0282%	1,9157%	1,50%	1.994.281.993,48	61
33	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	0,8487%	-0,3150	-0,0344%	1,7345%	0,08%	120.997.228,78	61
34	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	0,7789%	-0,2769	-0,0355%	2,0356%	0,14%	100.458.665,58	61

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/03/2025
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		ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	0,7525%	-0,2398	-0,0359%	2,3706%	2,00%	1.392.270.562,39	61
36		OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	0,7170%	-0,2438	-0,0365%	2,3720%	2,50%	112.118.298,79	61
37		FOF FRG FC FI MULT	-0,2833%	-0,2789	-0,0528%	3,0058%	0,00%	578.083.196,67	61
MÉDIA:			2,3795%	-0,1186	-0,0098%	1,3703%		626.088.125,62	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025
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	GALAPAGOS EVOLUTION FC FI MULT CRED PRIV	1,4176%	0,2028	0,0237%	1,8430%	2,00%	165.555.220,78	19
2	VINLAND MACRO FC FI MULTIMERCADO	1,2874%	0,0940	0,0170%	2,8586%	2,00%	103.117.328,79	19
3	ABSOLUTE ALPHA MARB FC FI MULTI	1,1843%	0,1107	0,0115%	1,6544%	2,50%	53.152.237,53	19
4	ICATU VANG MULT FC DE FI MULTI CRED PRIV	1,1344%	0,2865	0,0089%	0,4812%	1,00%	353.596.789,86	19
5	AZ QUEST LOW VOL FI MULT	1,1322%	0,1930	0,0088%	0,7102%	1,75%	2.240.343.395,26	19
6	DAYCOVAL MULTISTRATEGIA F I M	1,0838%	0,0438	0,0063%	2,3036%	1,00%	75.464.381,63	19
7	CAIXA FIC HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	1,0606%	0,1503	0,0050%	0,5260%	1,00%	52.913.758,22	19
8	ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULTIMERCADO	1,0445%	0,0987	0,0042%	0,6793%	2,00%	80.996.878,95	19
9	XP MACRO INSTITUCIONAL FC FI MULTI	0,9831%	0,0143	0,0010%	1,1327%	1,50%	67.551.362,60	19
10	MAG MULT FIF RESP LIM	0,9512%	-0,2431	-0,0007%	0,0483%	0,90%	112.600.435,49	19
11	SIC SCHROEDERS MCLAS FI MULT CRED PRIV LP	0,9421%	-0,0712	-0,0011%	0,2475%	0,70%	111.761.999,07	19
12	JGP MAX FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO	0,9286%	-0,0146	-0,0018%	1,9381%	2,50%	60.990.419,52	19
13	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,9246%	-0,2426	-0,0021%	0,1338%	0,70%	822.039.701,94	19
14	BB MULT LP JUROS E MOEDAS FC	0,9145%	-0,0380	-0,0026%	1,0825%	1,00%	8.399.082.197,33	19
15	MAG STRATEGY FI MULT	0,8990%	-0,0514	-0,0034%	1,0491%	0,85%	99.834.111,48	19
16	BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	0,8722%	-0,0340	-0,0047%	2,1976%	2,00%	105.634.097,75	19
17	JGP HEDGE FIC FI MULTIMERCADO	0,8722%	-0,0649	-0,0048%	1,1689%	2,00%	97.827.484,44	19
18	ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	0,8667%	-0,3241	-0,0051%	0,2376%	0,35%	96.548.348,36	19
19	VINCI MULTISTRATEGIA FI MULT	0,8562%	-0,6936	-0,0056%	0,1210%	1,00%	110.974.317,21	19
20	NOVUS INSTITUCIONAL FC MULT	0,7186%	-0,1423	-0,0128%	1,4309%	1,50%	141.815.484,31	19
21	BB MULT LP EMPRESA FC	0,7117%	-0,3072	-0,0132%	0,6731%	1,00%	107.786.819,43	19
22	BB MULT MACRO LP FC	0,6540%	-0,3581	-0,0162%	0,7103%	1,50%	718.536.150,38	19
23	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,6441%	-0,3077	-0,0167%	0,8734%	0,96%	829.511.446,97	19
24	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	0,6388%	-0,3905	-0,0170%	0,6797%	0,50%	527.406.478,82	19
25	AZ QUEST MULT FC FI MULT	0,6079%	-0,1761	-0,0186%	1,6631%	2,50%	70.494.766,94	19
26	OCCAM INST FC FI MULT II	0,5104%	-0,3295	-0,0237%	1,1419%	2,00%	105.900.048,65	19
27	ABSOLUTE HEDGE FC DE FI MULT	0,4519%	-0,2277	-0,0267%	1,8523%	1,90%	2.425.279.088,18	19
28	BAHIA AM MARAU FC DE FI MULT	0,4515%	-0,1800	-0,0267%	2,3732%	1,90%	318.526.750,14	19
29	OPPORTUNITY TOTAL FC FI MULTIMERCADO	0,3824%	-0,1690	-0,0303%	2,8391%	2,00%	255.594.491,22	19
30	PORTO SEGURO ALOCAÇÃO FC FI MULT	0,0460%	-0,4245	-0,0480%	1,7992%	0,50%	140.044.468,34	19
31	IAJA FC FI MULT CRED PRIV	-0,0410%	-0,5161	-0,0526%	1,6193%	0,08%	120.997.228,78	19
32	OCCAM EQUITY HEDGE FC FI MULTI	-0,2450%	-0,6059	-0,0634%	1,6593%	2,50%	112.118.298,79	19
33	FASC RJ MULTIMERCADO FC FI	-0,3651%	-0,4526	-0,0696%	2,4462%	0,14%	100.458.665,58	19
34	RECKITTPREV - ESTRUTURADO (ITAÚ)	-0,4232%	-0,4733	-0,0727%	2,4348%	0,30%	16.170.242,51	19

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025
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		ITAU GLOBAL DINAMICO MULT FICFI	-0,4301%	-0,4731	-0,0731%	2,4478%	1,50%	1.994.281.993,48	19
36		FOF FRG FC FI MULT	-0,7284%	-0,3323	-0,0886%	4,2364%	0,00%	578.083.196,67	19
37		ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	-0,7701%	-0,4725	-0,0910%	3,0533%	2,00%	1.392.270.562,39	19
		MÉDIA:	0,5992%	-0,1871	-0,0191%	1,4688%		626.088.125,62	

ReckittPREV

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

Março/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: 4,11682
PATRIMÔNIO: 10.126.965,94

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	55,63%
DÓLAR PTAX	44,37%		

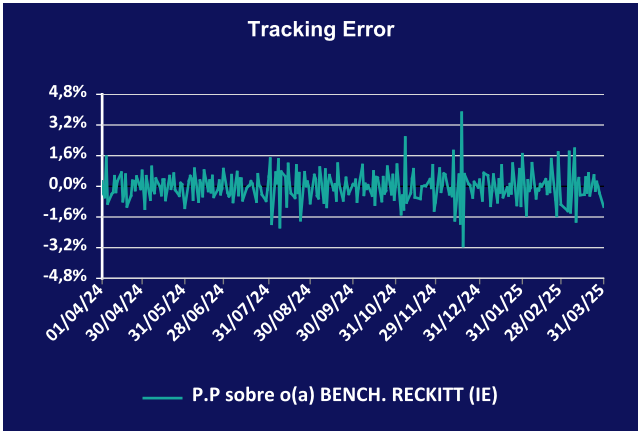
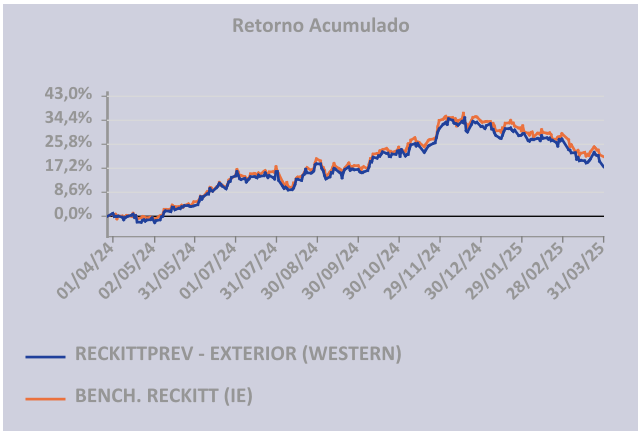
ESTILO: 24,81% | SELEÇÃO: 75,19%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0265%	18° de 36
RETORNO ACUMULADO	17,7336%	18° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	21,3474%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,6138%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0569%	24° de 36
BETA	0,6260	16° de 36
MARKET TIMING	7,1647	13° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,3888	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	69,1273%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	93,5248%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,2331	18° de 36
JENSEN	0,1566%	21° de 36
MODIGLIANI	-3,7095%	21° de 36
SHARPE	0,0286	21° de 36
SORTINO	0,0398	21° de 36
TREYNOR	0,0004	22° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	5,4871	--
DOWNSIDE RISK	0,6666%	21° de 36
RISCO ATIVO	0,8050%	22° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	12,7790%	22° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,7289%	22° de 36
RISCO TOTAL	0,9257%	20° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,6954%	20° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	7
MESES NEGATIVOS	5
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	6
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	6
MAIOR RETORNO MENSAL	9,8439%(06/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,8060%(03/2025)



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	-7,81%	-10,97%	17,73%	51,95%	52,39%	2,29% (31/07/2024)	-3,41% (19/12/2024)
BENCH. RECKITT (IE)	-6,38%	-9,25%	21,35%	49,71%	58,49%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI EUROPE	-0,66%	9,86%	4,12%	15,63%	14,16%	3,23% (05/03/2025)	-2,36% (19/12/2024)
MSCI WORLD	-4,64%	-2,14%	5,58%	29,99%	18,85%	1,83% (14/03/2025)	-3,08% (05/08/2024)
DÓLAR D2	-3,23%	-7,74%	13,99%	12,46%	20,28%	2,36% (23/12/2024)	-2,04% (03/07/2024)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	2,71% (28/11/2024)	-1,94% (06/08/2024)
EURO PTAX	1,92%	-3,68%	14,85%	12,22%	17,94%	2,58% (05/03/2025)	-2,22% (06/08/2024)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-6,38%	-9,25%	21,35%	46,93%	44,05%	2,80% (28/11/2024)	-2,60% (05/08/2024)
MSCI WORLD - BRL D2	-7,73%	-9,71%	20,35%	46,19%	42,95%	2,96% (23/12/2024)	-2,98% (05/08/2024)
S&P 500	-5,75%	-4,59%	6,80%	36,56%	23,87%	2,53% (06/11/2024)	-3,00% (05/08/2024)
S&P 500 BRL PTAX	-7,47%	-11,52%	22,75%	54,35%	50,13%	4,43% (29/11/2024)	-3,46% (06/03/2025)

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: 4,11682
PATRIMÔNIO: 10.126.965,94

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	66,51%
DÓLAR PTAX	33,49%		

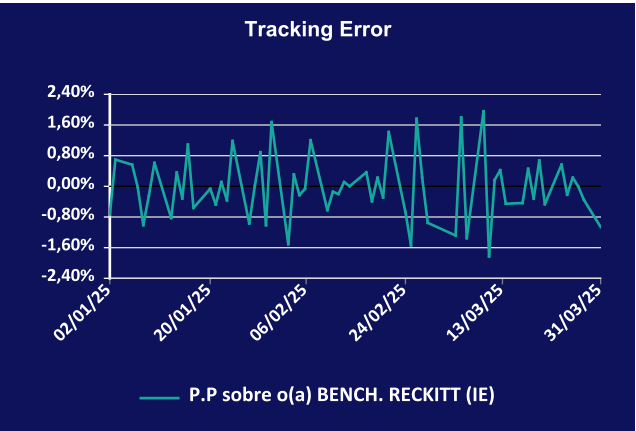
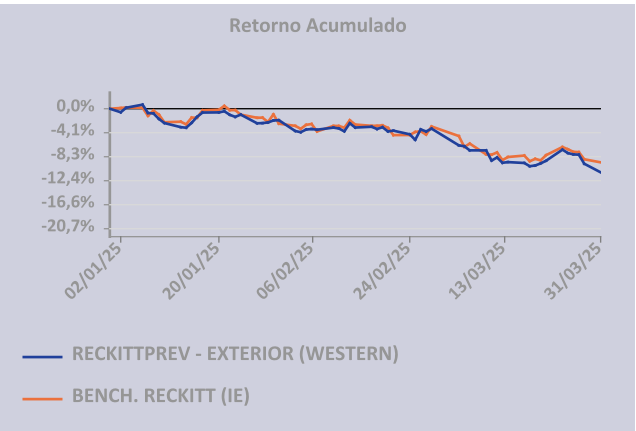
ESTILO: 35,74% | SELEÇÃO: 64,26%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,2347%	25° de 36
RETORNO ACUMULADO	-10,9736%	24° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	-9,2494%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,7241%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,2405%	21° de 36
BETA	0,6270	17° de 36
MARKET TIMING	16,8883	13° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,3185	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	94,5914%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9997%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	88,8078%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,5838	25° de 36
JENSEN	-7,2557%	18° de 36
MODIGLIANI	-1,4296%	27° de 36
SHARPE	-0,2635	25° de 36
SORTINO	-0,3014	26° de 36
TREYNOR	-0,0042	18° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,8198	--
DOWNSIDE RISK	0,7789%	21° de 36
RISCO ATIVO	0,8488%	20° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	13,4749%	20° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,7518%	19° de 36
RISCO TOTAL	0,8909%	25° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,1429%	25° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	3
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	-1,4821%(02/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,8060%(03/2025)



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	-7,81%	-10,97%	17,73%	51,95%	52,39%	2,10% (24/03/2025)	-2,98% (05/03/2025)
BENCH. RECKITT (IE)	-6,38%	-9,25%	21,35%	49,71%	58,49%	1,53% (24/03/2025)	-1,97% (10/03/2025)
MSCI EUROPE	-0,66%	9,86%	4,12%	15,63%	14,16%	3,23% (05/03/2025)	-1,66% (31/03/2025)
MSCI WORLD	-4,64%	-2,14%	5,58%	29,99%	18,85%	1,83% (14/03/2025)	-2,38% (10/03/2025)
DÓLAR D2	-3,23%	-7,74%	13,99%	12,46%	20,28%	1,27% (28/02/2025)	-2,00% (05/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,30% (04/02/2025)
EURO PTAX	1,92%	-3,68%	14,85%	12,22%	17,94%	2,58% (05/03/2025)	-1,53% (31/01/2025)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-6,38%	-9,25%	21,35%	46,93%	44,05%	1,53% (24/03/2025)	-1,97% (10/03/2025)
MSCI WORLD - BRL D2	-7,73%	-9,71%	20,35%	46,19%	42,95%	2,29% (28/02/2025)	-2,72% (05/03/2025)
S&P 500	-5,75%	-4,59%	6,80%	36,56%	23,87%	2,13% (14/03/2025)	-2,70% (10/03/2025)
S&P 500 BRL PTAX	-7,47%	-11,52%	22,75%	54,35%	50,13%	2,05% (24/03/2025)	-3,46% (06/03/2025)

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: 4,11682
PATRIMÔNIO: 10.126.965,94

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	41,65%	MSCI WORLD	6,13%
DÓLAR PTAX	52,21%		

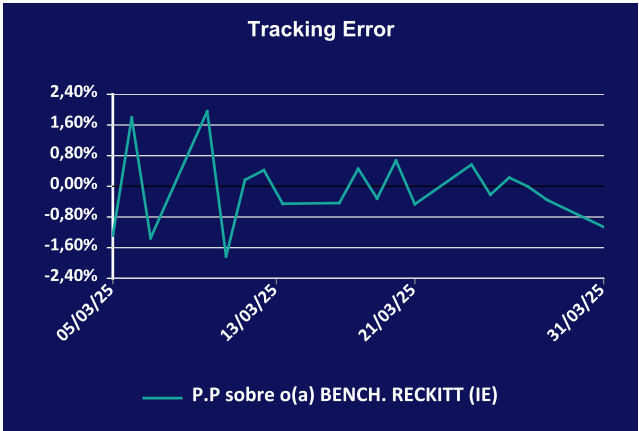
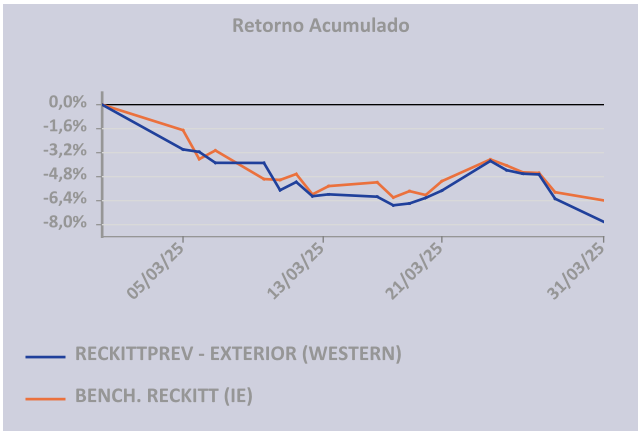
ESTILO: 32,13% | SELEÇÃO: 67,87%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,4714%	26° de 36
RETORNO ACUMULADO	-7,8059%	26° de 36
RETORNO DA REFERÊNCIA	-6,3811%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,4248%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,5369%	23° de 36
BETA	1,0045	13° de 36
MARKET TIMING	40,5144	10° de 36
R^2 DA REGRESSÃO	0,4855	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	94,5744%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,8552%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	94,6944%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,2978	22° de 36
JENSEN	-4,0431%	18° de 36
MODIGLIANI	-0,6658%	25° de 36
SHARPE	-0,4233	25° de 36
SORTINO	-0,4407	24° de 36
TREYNOR	-0,0073	20° de 36
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,6705	--
DOWNSIDE RISK	1,0695%	19° de 36
RISCO ATIVO	0,9713%	19° de 36
RISCO ATIVO ANUALIZADO	15,4203%	19° de 36
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,9011%	18° de 36
RISCO TOTAL	1,1139%	21° de 36
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,6827%	21° de 36

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-7,8060%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,8060%(03/2025)



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	-7,81%	-10,97%	17,73%	51,95%	52,39%	2,10% (24/03/2025)	-2,98% (05/03/2025)
BENCH. RECKITT (IE)	-6,38%	-9,25%	21,35%	49,71%	58,49%	1,53% (24/03/2025)	-1,97% (10/03/2025)
MSCI EUROPE	-0,66%	9,86%	4,12%	15,63%	14,16%	3,23% (05/03/2025)	-1,66% (31/03/2025)
MSCI WORLD	-4,64%	-2,14%	5,58%	29,99%	18,85%	1,83% (14/03/2025)	-2,38% (10/03/2025)
DÓLAR D2	-3,23%	-7,74%	13,99%	12,46%	20,28%	1,23% (10/03/2025)	-2,00% (05/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,22% (14/03/2025)
EURO PTAX	1,92%	-3,68%	14,85%	12,22%	17,94%	2,58% (05/03/2025)	-1,11% (14/03/2025)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-6,38%	-9,25%	21,35%	46,93%	44,05%	1,53% (24/03/2025)	-1,97% (10/03/2025)
MSCI WORLD - BRL D2	-7,73%	-9,71%	20,35%	46,19%	42,95%	1,87% (24/03/2025)	-2,72% (05/03/2025)
S&P 500	-5,75%	-4,59%	6,80%	36,56%	23,87%	2,13% (14/03/2025)	-2,70% (10/03/2025)
S&P 500 BRL PTAX	-7,47%	-11,52%	22,75%	54,35%	50,13%	2,05% (24/03/2025)	-3,46% (06/03/2025)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, MULTIMERCADO

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL

PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	INFORMATION RATIO	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	0,5096	0,6695	35,8794%	30,3045%	0,24%	23.582.367,15	253
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	0,4531	0,7070	27,4361%	14,1646%	0,20%	33.418.575,71	253
3	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	0,1600	0,4461	24,2205%	19,9663%	0,20%	781.360.643,46	253
4	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,0822	0,7528	22,3703%	14,5311%	0,22%	213.243.731,69	253
5	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,0617	0,7328	22,1396%	14,5380%	0,20%	258.684.592,47	253
6	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-0,0013	0,6458	21,4194%	13,9468%	0,07%	336.853.715,46	253
7	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-0,0091	0,5378	20,9937%	15,4884%	0,20%	483.375.551,26	253
8	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-0,0215	0,7143	20,9885%	14,8248%	0,06%	102.558.997,71	253
9	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-0,0250	0,4120	20,0634%	18,0388%	0,08%	528.326.644,34	253
10	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-0,0843	0,7660	20,0149%	15,4601%	0,40%	60.962.686,08	253
11	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-0,0880	0,7808	20,3095%	14,5227%	1,25%	198.481.784,35	253
12	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-0,0888	0,2644	19,4090%	14,6799%	0,08%	133.643.732,25	253
13	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-0,1262	0,7235	19,9912%	13,7161%	0,00%	329.223.707,48	253
14	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,1851	0,6683	19,0428%	13,7403%	0,50%	12.028.100,76	253
15	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-0,1930	0,5891	18,1948%	14,7202%	0,70%	8.951.717,86	253
16	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-0,2051	0,5976	17,9984%	14,8016%	0,70%	53.822.828,66	253
17	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,2132	0,6680	18,6801%	13,7334%	1,00%	622.870.677,82	253
18	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-0,2332	0,6261	17,7336%	14,6955%	0,35%	10.126.965,94	253
19	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,2353	0,4529	17,4151%	13,7006%	1,00%	61.524.704,28	253
20	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,2361	0,2230	15,7650%	15,7282%	0,60%	74.719.022,70	253
21	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,2522	0,4237	15,6410%	16,7074%	0,08%	1.541.204.757,42	253
22	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	-0,2779	0,4449	17,1211%	12,6918%	0,70%	85.281.972,87	253
23	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-0,3168	0,6074	17,3699%	12,9889%	0,55%	219.020.045,94	253
24	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,3493	0,5575	15,0668%	15,5019%	0,15%	124.889.819,42	253
25	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-0,3743	0,3965	12,7067%	17,2537%	0,15%	482.701.193,52	253
26	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-0,3872	0,4595	13,1788%	16,5754%	0,08%	88.431.726,62	253
27	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,4246	0,4405	13,8221%	14,2445%	0,50%	7.736.309,60	253
28	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,4418	0,2145	8,9922%	19,4325%	0,70%	54.476.633,30	253
29	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-0,4817	0,4520	10,8237%	17,2678%	0,30%	275.004.125,84	253
30	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-0,6606	0,5752	11,0254%	14,5222%	0,00%	22.187.755,19	253
31	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-0,7178	0,7670	9,3333%	17,3984%	0,70%	3.884.653,29	253
32	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-0,7812	0,2650	5,8405%	14,3570%	0,30%	4.614.160,48	253
33	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-0,9515	0,8774	9,2316%	16,5005%	0,75%	2.313.542,31	253
34	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,9699	0,9944	7,0765%	18,8154%	0,20%	9.813.260,64	253

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 01/04/2024 A 31/03/2025
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, MULTIMERCADO
PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA
APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL
PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING		FUNDO	INFORMATION RATIO	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
35		ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-1,0123	0,5629	0,2762%	18,7751%	0,60%	35.539.955,33	253
36		GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-1,2441	0,6564	5,1939%	14,0525%	1,75%	34.115.146,30	253
MÉDIA:			-0,2867	0,5742	16,4657%	15,8996%		203.304.883,49	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/01/2025 A 31/03/2025

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	2,5221	0,8085	-3,3563%	15,7414%	0,00%	22.187.755,19	61
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	2,4375	0,6352	-2,7101%	13,2453%	0,20%	33.418.575,71	61
3	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	1,5657	0,2099	-2,1449%	15,1606%	0,08%	133.643.732,25	61
4	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	0,7358	0,6708	-7,6020%	11,6621%	0,55%	219.020.045,94	61
5	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	0,3465	0,7759	-8,5137%	13,3235%	0,20%	258.684.592,47	61
6	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	0,2821	0,4331	-8,3385%	11,2549%	0,70%	85.281.972,87	61
7	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	0,2287	0,7831	-8,7157%	16,6863%	0,20%	9.813.260,64	61
8	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	0,1792	0,3227	-8,5807%	15,6522%	0,30%	4.614.160,48	61
9	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	0,1269	0,4415	-8,8086%	12,2051%	1,00%	61.524.704,28	61
10	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	0,1242	0,8727	-9,0070%	14,7608%	0,22%	213.243.731,69	61
11	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	0,0087	0,4751	-9,2797%	15,8303%	0,30%	275.004.125,84	61
12	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-0,0673	0,4264	-9,4177%	12,0207%	0,50%	7.736.309,60	61
13	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-0,1340	0,6986	-9,5689%	13,3568%	0,07%	336.853.715,46	61
14	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,2328	--	-10,3642%	14,7501%	0,60%	74.719.022,70	61
15	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,2837	0,3325	-10,3303%	14,1551%	0,08%	1.541.204.757,42	61
16	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-0,3246	0,8567	-9,9093%	14,2003%	0,00%	329.223.707,48	61
17	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-0,3342	0,3583	-10,7155%	16,3361%	0,08%	528.326.644,34	61
18	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-0,3515	0,5866	-10,3695%	14,3275%	0,70%	53.822.828,66	61
19	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-0,3669	0,5022	-11,1724%	20,7047%	0,20%	781.360.643,46	61
20	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-0,3809	0,8838	-10,1152%	15,3502%	1,25%	198.481.784,35	61
21	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-0,3872	0,7532	-10,0555%	12,9965%	0,50%	12.028.100,76	61
22	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-0,3882	0,5505	-10,6269%	15,0976%	0,20%	483.375.551,26	61
23	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-0,3895	0,5918	-10,4690%	14,2203%	0,70%	8.951.717,86	61
24	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-0,4147	0,7524	-10,1136%	12,9838%	1,00%	622.870.677,82	61
25	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-0,5839	0,6270	-10,9736%	14,1429%	0,35%	10.126.965,94	61
26	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,6530	0,5236	-11,5514%	15,0295%	0,15%	124.889.819,42	61
27	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-0,7471	0,5721	-11,2877%	13,1111%	0,06%	102.558.997,71	61
28	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-0,7527	0,4771	-11,9329%	15,1585%	0,08%	88.431.726,62	61
29	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-0,7699	0,6491	-11,1969%	13,2566%	1,75%	34.115.146,30	61
30	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-0,7876	0,3547	-12,3027%	14,5866%	0,15%	482.701.193,52	61
31	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-1,1450	--	-15,4886%	19,0062%	0,70%	54.476.633,30	61
32	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-1,1454	0,9098	-18,7297%	36,3115%	0,24%	23.582.367,15	61
33	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-1,2651	0,9402	-11,7469%	15,4244%	0,40%	60.962.686,08	61
34	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-1,5809	0,6133	-15,1109%	17,4419%	0,60%	35.539.955,33	61

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/01/2025 A 31/03/2025
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		ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-2,5269	1,3058	-17,6925%	23,1130%	0,70%	3.884.653,29	61
36		MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-2,7400	0,9136	-13,4202%	14,8298%	0,75%	2.313.542,31	61
MÉDIA:			-0,2832	0,5961	-10,3255%	15,4843%		203.304.883,49	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, MULTIMERCADO

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL

PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	INFORMATION RATIO	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	3,1100	0,3187	-3,0758%	12,8148%	0,20%	33.418.575,71	19
2	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	2,3246	1,1314	-4,5863%	21,3951%	0,00%	22.187.755,19	19
3	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	1,5910	0,2957	-3,3195%	20,8420%	0,08%	133.643.732,25	19
4	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	0,5665	0,7912	-5,6723%	17,4690%	0,30%	275.004.125,84	19
5	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	0,4872	0,6871	-5,8519%	13,3606%	0,70%	85.281.972,87	19
6	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	0,0739	0,6844	-6,2769%	14,9077%	0,50%	7.736.309,60	19
7	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-0,1387	0,9138	-6,4482%	15,0433%	0,20%	258.684.592,47	19
8	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-0,1650	0,0329	-6,7563%	20,6423%	0,60%	74.719.022,70	19
9	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-0,3391	0,9708	-6,8590%	18,5517%	0,15%	124.889.819,42	19
10	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-0,5138	0,7678	-6,9286%	15,4563%	1,00%	61.524.704,28	19
11	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-0,5967	0,3678	-7,0993%	19,9419%	0,20%	9.813.260,64	19
12	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-0,7749	0,9472	-7,4511%	19,1564%	0,20%	483.375.551,26	19
13	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-0,7832	0,6682	-7,4619%	17,5088%	0,08%	1.541.204.757,42	19
14	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-0,8495	1,0088	-7,1496%	16,9259%	0,07%	336.853.715,46	19
15	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-0,8724	--	-8,4760%	25,1659%	0,70%	54.476.633,30	19
16	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-0,9409	0,7804	-7,3109%	15,0887%	0,06%	102.558.997,71	19
17	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-0,9829	0,2468	-8,1893%	21,2279%	0,30%	4.614.160,48	19
18	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-1,0029	0,9150	-7,6561%	17,1354%	0,15%	482.701.193,52	19
19	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-1,0081	0,9401	-7,5947%	17,6851%	0,70%	8.951.717,86	19
20	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-1,0297	0,9560	-7,6161%	17,7990%	0,70%	53.822.828,66	19
21	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-1,0656	0,8826	-7,1325%	14,0568%	0,55%	219.020.045,94	19
22	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-1,2979	1,0046	-7,8060%	17,6827%	0,35%	10.126.965,94	19
23	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-1,3223	1,0160	-7,3498%	16,3527%	0,50%	12.028.100,76	19
24	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-1,3555	1,0158	-7,3742%	16,3493%	1,00%	622.870.677,82	19
25	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	-1,3579	1,0447	-7,2877%	17,1966%	0,22%	213.243.731,69	19
26	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-1,5066	0,9591	-8,2708%	18,8248%	0,08%	528.326.644,34	19
27	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-1,6693	1,0723	-7,5243%	17,9802%	0,00%	329.223.707,48	19
28	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-1,7499	1,3176	-7,4833%	20,0987%	0,40%	60.962.686,08	19
29	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-2,2549	0,9042	-9,2748%	19,8021%	0,08%	88.431.726,62	19
30	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-2,2995	1,1901	-7,6307%	18,5716%	1,25%	198.481.784,35	19
31	GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-2,6990	2,2119	-14,1633%	46,7511%	0,24%	23.582.367,15	19
32	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-2,9586	1,1506	-10,7559%	26,1014%	0,20%	781.360.643,46	19
33	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-3,3945	0,8251	-9,4291%	15,3758%	1,75%	34.115.146,30	19
34	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-4,4011	1,1768	-11,9285%	21,8833%	0,60%	35.539.955,33	19

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANALISE: 05/03/2025 A 31/03/2025
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		MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-4,5723	0,9383	-8,5124%	18,0518%	0,75%	2.313.542,31	19
36		ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-5,2302	1,8554	-12,0428%	28,7587%	0,70%	3.884.653,29	19
MÉDIA:			-1,1383	0,8859	-7,6596%	19,2210%		203.304.883,49	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/04/2024 A 31/03/2025
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	35,8794%	17,8698%	0,6695	30,3045%	0,24%	23.582.367,15	253
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	27,4361%	9,0397%	0,7070	14,1646%	0,20%	33.418.575,71	253
3	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	24,2205%	8,4594%	0,4461	19,9663%	0,20%	781.360.643,46	253
4	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	22,3703%	3,5151%	0,7528	14,5311%	0,22%	213.243.731,69	253
5	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	22,1396%	3,4859%	0,7328	14,5380%	0,20%	258.684.592,47	253
6	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	21,4194%	3,6431%	0,6458	13,9468%	0,07%	336.853.715,46	253
7	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	20,9937%	4,3061%	0,5378	15,4884%	0,20%	483.375.551,26	253
8	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	20,9885%	2,5225%	0,7143	14,8248%	0,06%	102.558.997,71	253
9	BRADESCO GLOBAL FIA IE	20,3095%	1,1727%	0,7808	14,5227%	1,25%	198.481.784,35	253
10	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	20,0634%	4,6447%	0,4120	18,0388%	0,08%	528.326.644,34	253
11	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	20,0149%	1,0274%	0,7660	15,4601%	0,40%	60.962.686,08	253
12	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	19,9912%	1,4316%	0,7235	13,7161%	0,00%	329.223.707,48	253
13	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	19,4090%	5,4752%	0,2644	14,6799%	0,08%	133.643.732,25	253
14	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	19,0428%	1,0398%	0,6683	13,7403%	0,50%	12.028.100,76	253
15	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	18,6801%	0,6801%	0,6680	13,7334%	1,00%	622.870.677,82	253
16	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	18,1948%	0,9899%	0,5891	14,7202%	0,70%	8.951.717,86	253
17	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	17,9984%	0,7084%	0,5976	14,8016%	0,70%	53.822.828,66	253
18	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	17,7336%	0,1566%	0,6261	14,6955%	0,35%	10.126.965,94	253
19	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	17,4151%	1,5836%	0,4529	13,7006%	1,00%	61.524.704,28	253
20	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	17,3699%	-0,0198%	0,6074	12,9889%	0,55%	219.020.045,94	253
21	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	17,1211%	1,3693%	0,4449	12,6918%	0,70%	85.281.972,87	253
22	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	15,7650%	2,2515%	0,2230	15,7282%	0,60%	74.719.022,70	253
23	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	15,6410%	0,1047%	0,4237	16,7074%	0,08%	1.541.204.757,42	253
24	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	15,0668%	-1,8187%	0,5575	15,5019%	0,15%	124.889.819,42	253
25	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	13,8221%	-1,8851%	0,4405	14,2445%	0,50%	7.736.309,60	253
26	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	13,1788%	-2,7176%	0,4595	16,5754%	0,08%	88.431.726,62	253
27	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	12,7067%	-2,5544%	0,3965	17,2537%	0,15%	482.701.193,52	253
28	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	11,0254%	-6,0401%	0,5752	14,5222%	0,00%	22.187.755,19	253
29	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	10,8237%	-4,9989%	0,4520	17,2678%	0,30%	275.004.125,84	253
30	ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	9,3333%	-9,6617%	0,7670	17,3984%	0,70%	3.884.653,29	253
31	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	9,2316%	-10,8788%	0,8774	16,5005%	0,75%	2.313.542,31	253
32	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	8,9922%	-4,4334%	0,2145	19,4325%	0,70%	54.476.633,30	253
33	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	7,0765%	-14,2160%	0,9944	18,8154%	0,20%	9.813.260,64	253
34	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	5,8405%	-8,0990%	0,2650	14,3570%	0,30%	4.614.160,48	253

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE:

01/04/2024 A 31/03/2025

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	5,1939%	-12,6900%	0,6564	14,0525%	1,75%	34.115.146,30	253
36		ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	0,2762%	-16,6626%	0,5629	18,7751%	0,60%	35.539.955,33	253
MÉDIA:			16,4657%	-0,5889%	0,5742	15,8996%		203.304.883,49	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2025 A 31/03/2025

CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES, MULTIMERCADO

PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA

APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL

PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-2,1449%	-4,4367%	0,2099	15,1606%	0,08%	133.643.732,25	61
2	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-2,7101%	1,6142%	0,6352	13,2453%	0,20%	33.418.575,71	61
3	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-3,3563%	4,2288%	0,8085	15,7414%	0,00%	22.187.755,19	61
4	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-7,6020%	-3,1416%	0,6708	11,6621%	0,55%	219.020.045,94	61
5	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	-8,3385%	-6,9617%	0,4331	11,2549%	0,70%	85.281.972,87	61
6	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-8,5137%	-2,5423%	0,7759	13,3235%	0,20%	258.684.592,47	61
7	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-8,5807%	-8,4402%	0,3227	15,6522%	0,30%	4.614.160,48	61
8	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-8,7157%	-1,6615%	0,7831	16,6863%	0,20%	9.813.260,64	61
9	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-8,8086%	-7,2721%	0,4415	12,2051%	1,00%	61.524.704,28	61
10	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	-9,0070%	-2,0413%	0,8727	14,7608%	0,22%	213.243.731,69	61
11	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-9,2797%	-8,1435%	0,4751	15,8303%	0,30%	275.004.125,84	61
12	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-9,4177%	-8,6851%	0,4264	12,0207%	0,50%	7.736.309,60	61
13	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-9,5689%	-4,8455%	0,6986	13,3568%	0,07%	336.853.715,46	61
14	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-9,9093%	-2,9991%	0,8567	14,2003%	0,00%	329.223.707,48	61
15	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-10,0555%	-4,5958%	0,7532	12,9965%	0,50%	12.028.100,76	61
16	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-10,1136%	-4,6623%	0,7524	12,9838%	1,00%	622.870.677,82	61
17	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-10,1152%	-2,5378%	0,8838	15,3502%	1,25%	198.481.784,35	61
18	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-10,3303%	-10,3063%	0,3325	14,1551%	0,08%	1.541.204.757,42	61
19	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-10,3642%	-14,8289%	--	14,7501%	0,60%	74.719.022,70	61
20	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-10,3695%	-7,2868%	0,5866	14,3275%	0,70%	53.822.828,66	61
21	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-10,4690%	-7,3124%	0,5918	14,2203%	0,70%	8.951.717,86	61
22	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-10,6269%	-8,1737%	0,5505	15,0976%	0,20%	483.375.551,26	61
23	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-10,7155%	-10,5527%	0,3583	16,3361%	0,08%	528.326.644,34	61
24	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-10,9736%	-7,2557%	0,6270	14,1429%	0,35%	10.126.965,94	61
25	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-11,1724%	-8,2503%	0,5022	20,7047%	0,20%	781.360.643,46	61
26	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-11,1969%	-6,8437%	0,6491	13,2566%	1,75%	34.115.146,30	61
27	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-11,2877%	-7,7955%	0,5721	13,1111%	0,06%	102.558.997,71	61
28	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-11,5514%	-9,3446%	0,5236	15,0295%	0,15%	124.889.819,42	61
29	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-11,7469%	-3,5599%	0,9402	15,4244%	0,40%	60.962.686,08	61
30	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-11,9329%	-9,8350%	0,4771	15,1585%	0,08%	88.431.726,62	61
31	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-12,3027%	-12,4720%	0,3547	14,5866%	0,15%	482.701.193,52	61
32	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-13,4202%	-4,8458%	0,9136	14,8298%	0,75%	2.313.542,31	61
33	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-15,1109%	-11,5624%	0,6133	17,4419%	0,60%	35.539.955,33	61
34	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-15,4886%	-20,6369%	--	19,0062%	0,70%	54.476.633,30	61

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANALISE: 02/01/2025 A 31/03/2025
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		ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-17,6925%	-4,9350%	1,3058	23,1130%	0,70%	3.884.653,29	61
36		GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-18,7297%	-12,1749%	0,9098	36,3115%	0,24%	23.582.367,15	61
		MÉDIA:	-10,3255%	-6,8082%	0,5961	15,4843%		203.304.883,49	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 05/03/2025 A 31/03/2025

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	ACADIAN GLOBAL MANAGED VOL EQ USD FIA IE	-3,0758%	-1,0612%	0,3187	12,8148%	0,20%	33.418.575,71	19
2	BB MULT NORDEA INVEST NO EXTERIOR FI	-3,3195%	-4,9670%	0,2957	20,8420%	0,08%	133.643.732,25	19
3	BRAM ALOC SIST FI MULT EQT GLOBAIS	-4,5863%	2,7994%	1,1314	21,3951%	0,00%	22.187.755,19	19
4	BB ACOE NORD GLOB CLIM AND ENVI IS IE FI	-5,6723%	-3,2157%	0,7912	17,4690%	0,30%	275.004.125,84	19
5	VOT FI TOP MANAG GLOBAL ALLOC MULT IE	-5,8519%	-3,5865%	0,6871	13,3606%	0,70%	85.281.972,87	19
6	BRAD MULTI GLOBAL EQ ESG USD FIA IE IS	-6,2769%	-4,7214%	0,6844	14,9077%	0,50%	7.736.309,60	19
7	WE VE DO ADV MAS CLA INV ACO IE RESP LIM	-6,4482%	-1,4607%	0,9138	15,0433%	0,20%	258.684.592,47	19
8	BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	-6,7563%	-8,6003%	0,0329	20,6423%	0,60%	74.719.022,70	19
9	ITAU ACOES GLOB ESG IE FC SUSTENTAVEL	-6,8590%	-4,2634%	0,9708	18,5517%	0,15%	124.889.819,42	19
10	CAIXA FC MULT MULTIG GLOBAL EQUITIES IE	-6,9286%	-4,1473%	0,7678	15,4563%	1,00%	61.524.704,28	19
11	MAN GLG GLOBAL SUST GROWTH USD FIA IE	-7,0993%	-2,3681%	0,3678	19,9419%	0,20%	9.813.260,64	19
12	FOF MULTI GLOBAL EQUITIES MULTI IE FICFI	-7,1325%	-3,1297%	0,8826	14,0568%	0,55%	219.020.045,94	19
13	BB ACOES GLOBAIS INDEXADO IE FI	-7,1496%	-2,6698%	1,0088	16,9259%	0,07%	336.853.715,46	19
14	BRADESCO GLOBAL INSTITUCIONAL FC FIA IE	-7,2877%	-1,6458%	1,0447	17,1966%	0,22%	213.243.731,69	19
15	BLACKROCK FIA GLOBAIS ESG IE	-7,3109%	-4,2308%	0,7804	15,0887%	0,06%	102.558.997,71	19
16	SANT GLOBAL EQU INST DOLAR MULT IE FC FI	-7,3498%	-2,3909%	1,0160	16,3527%	0,50%	12.028.100,76	19
17	SANT GLOBAL EQUI DOLAR MAS MULT IE FC FI	-7,3742%	-2,4177%	1,0158	16,3493%	1,00%	622.870.677,82	19
18	ITAU WORLD EQUITIES FC ACOES IE	-7,4511%	-4,6276%	0,9472	19,1564%	0,20%	483.375.551,26	19
19	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	-7,4619%	-5,6854%	0,6682	17,5088%	0,08%	1.541.204.757,42	19
20	BRAD QUANT INSTITUCIONAL GLOBAL FIA USD	-7,4833%	-0,1191%	1,3176	20,0987%	0,40%	60.962.686,08	19
21	BRAD IS MULTIMAN EQUI USD FC DE FIA IE	-7,5243%	-1,5472%	1,0723	17,9802%	0,00%	329.223.707,48	19
22	WA GLOBAL EQUITIES FIA IE	-7,5947%	-4,4816%	0,9401	17,6851%	0,70%	8.951.717,86	19
23	WA GLOBAL EQUITIES II FIA IE	-7,6161%	-4,4106%	0,9560	17,7990%	0,70%	53.822.828,66	19
24	BRADESCO GLOBAL FIA IE	-7,6307%	-0,8690%	1,1901	18,5716%	1,25%	198.481.784,35	19
25	SCHRODER SUST ACOES GLOB USD FIA IS IE	-7,6561%	-5,3266%	0,9150	17,1354%	0,15%	482.701.193,52	19
26	RECKITTPREV - EXTERIOR (WESTERN)	-7,8060%	-4,0432%	1,0046	17,6827%	0,35%	10.126.965,94	19
27	BB MULT NORDEA ALPHA 15 LP IE FI	-8,1893%	-8,1325%	0,2468	21,2279%	0,30%	4.614.160,48	19
28	BB MULTIMERCADO SCHRODER IE FI	-8,2708%	-4,9254%	0,9591	18,8248%	0,08%	528.326.644,34	19
29	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC FI MULT IE	-8,4760%	-11,4798%	--	25,1659%	0,70%	54.476.633,30	19
30	MAN JSS SUST EQ GLOB THEM USD FI MULT IE	-8,5124%	-1,8268%	0,9383	18,0518%	0,75%	2.313.542,31	19
31	BB MULTIMERCADO BLACKROCK IE FI	-9,2748%	-5,6635%	0,9042	19,8021%	0,08%	88.431.726,62	19
32	GEO GLOBAL EQUIT FI COTAS FI EM ACOES IE	-9,4291%	-5,7390%	0,8251	15,3758%	1,75%	34.115.146,30	19
33	MS GLOBAL OPP ADVISORY MASTER FIA IE	-10,7559%	-4,4717%	1,1506	26,1014%	0,20%	781.360.643,46	19
34	ITAU SEL BLACK GLO UNC ACOES USD IE FC	-11,9285%	-7,0811%	1,1768	21,8833%	0,60%	35.539.955,33	19

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE:

05/03/2025 A 31/03/2025

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		ACCESS EQUITY WORLD FIA - IE SUS IS	-12,0428%	-0,9533%	1,8554	28,7587%	0,70%	3.884.653,29	19
36		GLOBAL INSIGHT FUND DOLAR FIA IE	-14,1633%	-2,0977%	2,2119	46,7511%	0,24%	23.582.367,15	19
MÉDIA:			-7,6596%	-3,7655%	0,8859	19,2210%		203.304.883,49	

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

ReckittPREV

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

Março/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: 3,08864
PATRIMÔNIO: 169.682.973,71

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	79,53%	IBX	5,99%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	7,10%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	6,07%	DÓLAR PTAX	1,32%

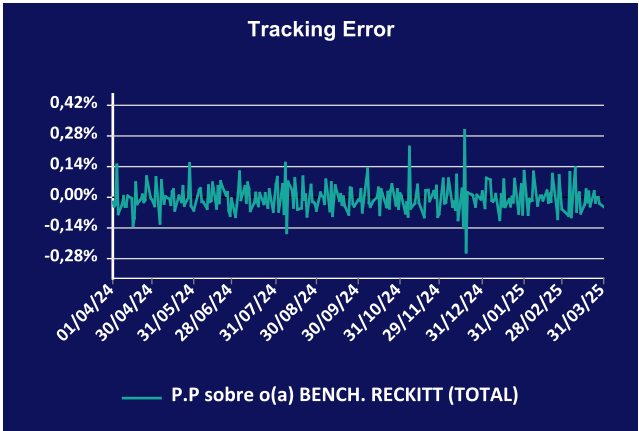
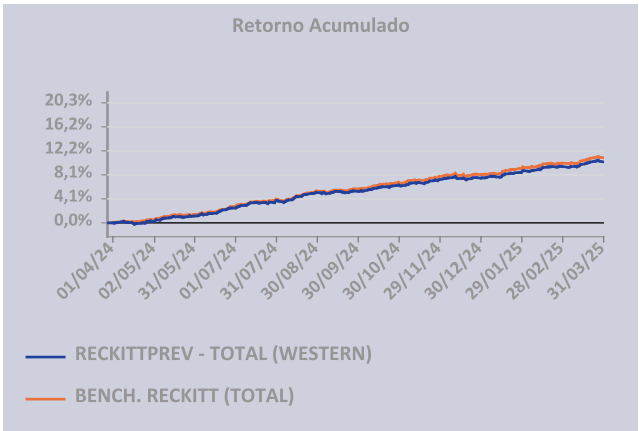
ESTILO: 45,04% | SELEÇÃO: 54,96%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0034%	--
RETORNO ACUMULADO	10,3111%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	11,0227%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,7116%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0006%	--
BETA	0,0618	--
MARKET TIMING	-0,1165	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,4118	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	10,4644%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	30,3176%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,6512	--
JENSEN	-0,3939%	--
MODIGLIANI	-0,8024%	--
SHARPE	-0,0399	--
SORTINO	-0,0534	--
TREYNOR	-0,0005	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,1554	--
DOWNSIDE RISK	0,0638%	--
RISCO ATIVO	0,0620%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9856%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0650%	--
RISCO TOTAL	0,0850%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3495%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	4
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	8
MAIOR RETORNO MENSAL	1,3432%(06/2024)
MENOR RETORNO MENSAL	0,2072%(09/2024)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,69%	2,50%	10,31%	26,72%	35,37%	0,31% (31/07/2024)	-0,27% (12/12/2024)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,83%	2,62%	11,02%	26,09%	39,01%	0,32% (30/01/2025)	-0,43% (18/12/2024)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,04% (27/06/2024)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-3,15% (18/12/2024)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-3,17% (18/12/2024)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-3,68% (18/12/2024)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-4,45% (18/12/2024)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-2,97% (18/12/2024)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,90% (19/12/2024)	-0,73% (07/06/2024)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,70% (19/12/2024)	-0,60% (12/12/2024)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-1,81% (16/12/2024)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	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: 3,08864
PATRIMÔNIO: 169.682.973,71

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	93,99%	IBX	4,44%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,98%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,58%

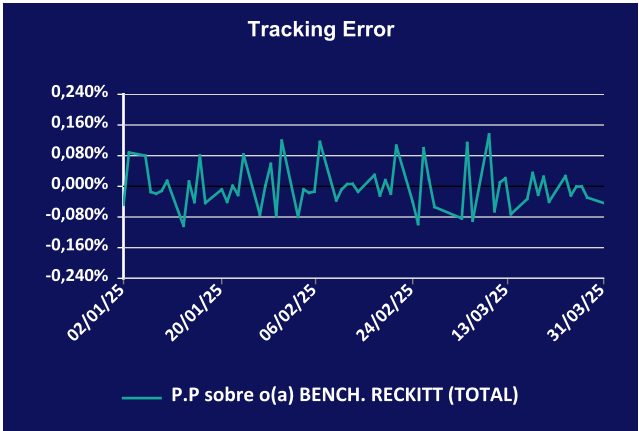
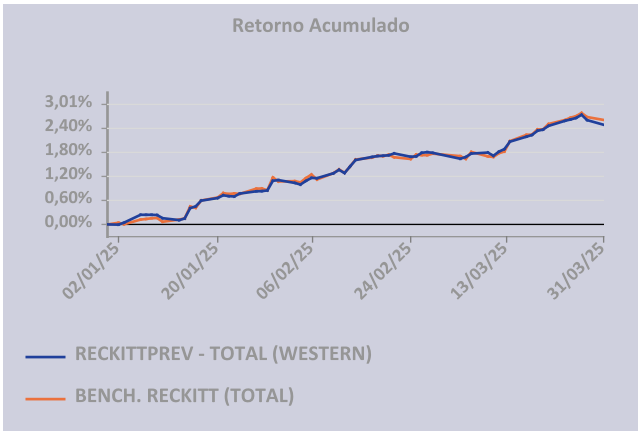
ESTILO: 51,32% | SELEÇÃO: 48,68%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0078%	--
RETORNO ACUMULADO	2,4967%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,6179%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1212%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0177%	--
BETA	0,0514	--
MARKET TIMING	0,4911	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5167	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	94,4072%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	68,0024%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,5360	--
JENSEN	-0,7843%	--
MODIGLIANI	-11,4992%	--
SHARPE	-0,0944	--
SORTINO	-0,1276	--
TREYNOR	-0,0014	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,7239	--
DOWNSIDE RISK	0,0616%	--
RISCO ATIVO	0,0577%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9172%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0583%	--
RISCO TOTAL	0,0831%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,3198%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1119%(01/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,6742%(02/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,69%	2,50%	10,31%	26,72%	35,37%	0,26% (15/01/2025)	-0,15% (05/03/2025)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,83%	2,62%	11,02%	26,09%	39,01%	0,32% (30/01/2025)	-0,12% (07/02/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/01/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,82% (30/01/2025)	-1,69% (12/02/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,83% (30/01/2025)	-1,68% (12/02/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	2,87% (15/01/2025)	-1,84% (16/01/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,59% (15/01/2025)	-2,19% (16/01/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,81% (12/02/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,64% (30/01/2025)	-0,39% (28/02/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,61% (30/01/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	1,50% (30/01/2025)	-0,93% (24/02/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,30% (04/02/2025)

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: 3,08864
PATRIMÔNIO: 169.682.973,71

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	88,44%	IBX	5,88%
IVBX-2	0,00%	SMLL	1,60%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	4,08%

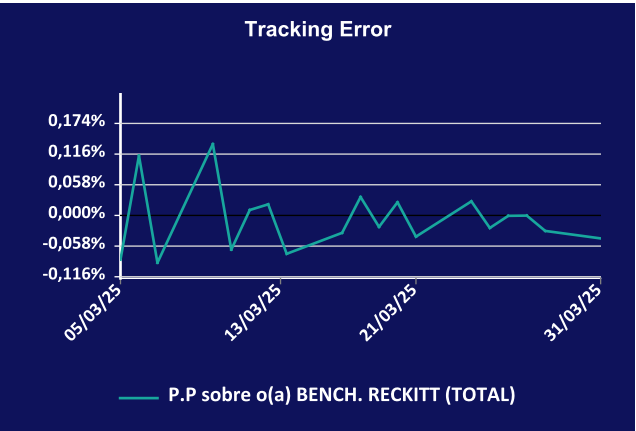
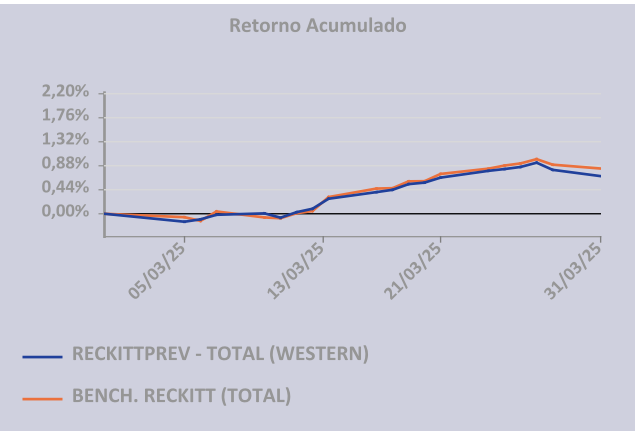
ESTILO: 54,56% | SELEÇÃO: 45,44%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0142%	--
RETORNO ACUMULADO	0,6908%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,8293%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1385%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0265%	--
BETA	0,0717	--
MARKET TIMING	-0,6450	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,4885	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	82,0123%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,6093%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	36,8399%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,9304	--
JENSEN	-0,5948%	--
MODIGLIANI	-7,8828%	--
SHARPE	-0,1555	--
SORTINO	-0,1812	--
TREYNOR	-0,0022	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,0650	--
DOWNSIDE RISK	0,0785%	--
RISCO ATIVO	0,0596%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9462%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0662%	--
RISCO TOTAL	0,0911%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4472%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,6908%(03/2025)
MENOR RETORNO MENSAL	0,6908%(03/2025)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,69%	2,50%	10,31%	26,72%	35,37%	0,18% (14/03/2025)	-0,15% (05/03/2025)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,83%	2,62%	11,02%	26,09%	39,01%	0,26% (14/03/2025)	-0,11% (10/03/2025)
CDI	0,96%	2,99%	11,28%	25,02%	41,63%	0,05% (20/03/2025)	0,05% (07/03/2025)
IBOVESPA	6,08%	8,29%	1,68%	27,85%	8,55%	2,64% (14/03/2025)	-1,25% (31/03/2025)
IBX	5,94%	8,17%	2,04%	27,74%	7,24%	2,66% (14/03/2025)	-1,23% (31/03/2025)
IVBX-2	4,65%	6,57%	-5,83%	19,21%	-11,16%	1,47% (07/03/2025)	-1,40% (24/03/2025)
SMLL	6,73%	8,87%	-14,90%	5,64%	-23,89%	3,13% (14/03/2025)	-1,55% (31/03/2025)
IDIV	5,52%	6,19%	7,49%	36,73%	27,94%	2,61% (14/03/2025)	-1,27% (31/03/2025)
IRF-M	1,39%	4,63%	4,82%	19,52%	33,33%	0,48% (05/03/2025)	-0,38% (20/03/2025)
IMA B 5	0,55%	3,11%	7,25%	17,58%	29,79%	0,23% (11/03/2025)	-0,22% (20/03/2025)
IMA B 5+	2,83%	3,70%	-3,80%	9,08%	14,56%	0,87% (05/03/2025)	-0,54% (20/03/2025)
DÓLAR PTAX	-1,82%	-7,27%	14,93%	13,03%	21,20%	1,08% (21/03/2025)	-1,22% (14/03/2025)