

Fevereiro 2025

Warren FO Tático RF FIM CP

Sobre o fundo

Início em 16/02/2022

O Warren FO Tático RF tem como objetivo essencial ser o veículo de implementação da alocação tática das Carteiras de gestão discricionária Warren. É por meio deste fundo que nosso time de alocação investe em diferentes indexadores de renda fixa dependendo dos níveis de preços vigentes. A alocação neutra do fundo - a alocação quando não há oportunidade identificada - é composta de 50% de renda fixa pós fixada e 50% em renda fixa inflação, sendo investido em títulos públicos de alta liquidez para possibilitar a agilidade necessária de seu mandato. Com isso, consideramos como benchmark teórico do fundo um índice composto de 50% de CDI e 50% IMA-B.

Melhor mês
Fev/25

3,87%

Pior mês
Dez/24

-1,11%

Positivo/Neg.
12 meses

↗ 10

↘ 2

Benchmark Teórico
50% CDI + 50% IMA-B

Um benchmark teórico é um parâmetro de desempenho construído de forma hipotética para refletir o comportamento esperado de uma estratégia de investimento, servindo como referência para avaliação de resultados.

Acima/Abaixo
50% CDI + 50% IMA-B

↗ 7

↘ 5

Meta de risco
2% a 5%

4,59%

Warren FO Tático RF FIM CP

Para Todos Investidores

Principais mercados

Renda Fixa Pós, Renda Fixa Pré, Renda Fixa IPCA

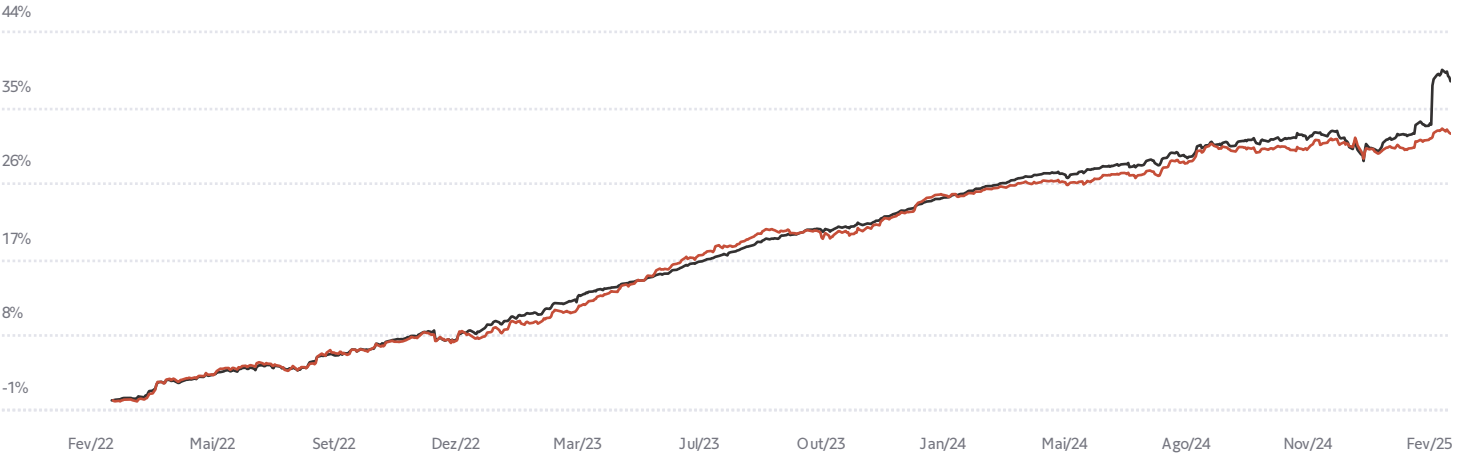
Categoria
Multimercados LivreGestor
Warren BrasilCNPJ
44.283.966/0001-59Administrador
Vortx

Custodiante

Auditoria
Deloitte Touche TohmatsuTaxa de administração
0,10%Taxa de performance
0,00%Tributação
Longo PrazoAplicação inicial
R\$ 1,00Movimentação mínima
R\$ 1,00Patrimônio líquido
R\$ 90.182.045,08Cotização da aplicação
D+0Cotização do resgate
D+2Pagamento do resgate
D+4Benchmark
50% CDI + 50% IMA-BExposição cambial
Não

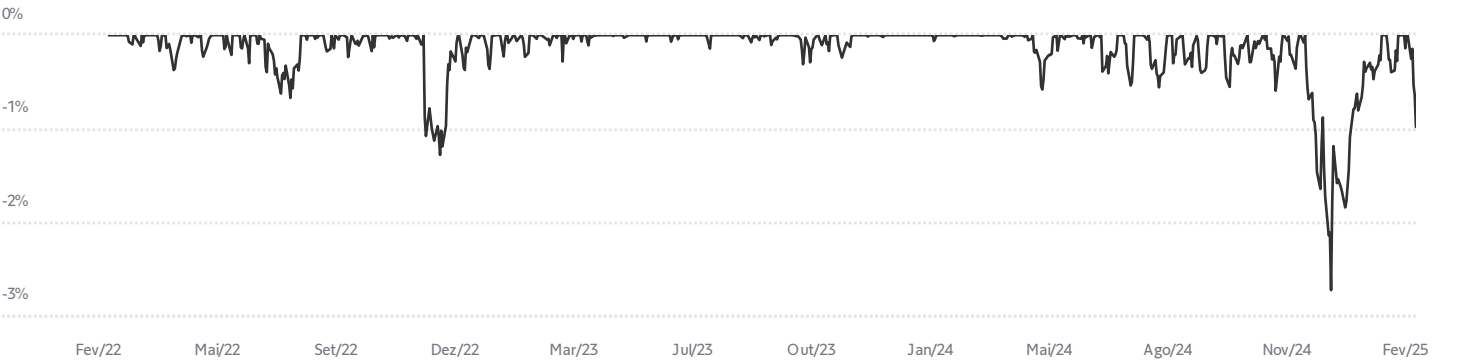
Performance histórica (%)

Fundo 50% CDI + 50% IMA-B



Anos e Índices	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Início
2025	2,43	3,87	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6,39	38,24
Benchmark	1,04	0,75	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,80	31,96
% Benchmark	232,73	517,90	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	355,41	119,63
2024	0,94	0,78	0,74	0,01	0,82	0,13	0,90	0,67	0,43	0,48	-0,20	-1,11	4,67	29,94
Benchmark	0,26	0,68	0,45	-0,37	1,08	-0,09	1,50	0,69	0,08	0,14	0,41	-0,85	4,03	29,63
% Benchmark	365,90	115,79	162,51	-3,92	75,74	-137,70	60,07	96,14	515,31	351,64	-48,80	130,05	115,87	101,03
2023	0,93	1,16	1,41	0,85	1,26	1,23	1,18	1,03	0,61	0,39	1,37	1,20	13,35	24,13
Benchmark	0,56	1,10	1,92	1,47	1,83	1,73	0,94	0,38	0,01	0,19	1,75	1,82	14,57	24,60
% Benchmark	164,79	104,82	73,44	57,81	68,81	70,96	125,25	271,87	5.071,19	206,04	78,22	65,95	91,68	98,09
2022	-	0,28	1,82	0,70	0,84	0,47	0,37	1,21	1,12	1,08	-0,12	1,36	9,51	9,51
Benchmark	-	0,08	2,00	0,83	1,00	0,33	0,08	1,14	1,28	1,13	0,12	0,47	8,76	8,76
% Benchmark	-	340,68	91,06	84,35	83,68	145,57	482,02	105,60	87,30	95,91	-98,20	292,56	108,52	108,52

Drawdown - Máxima perda acumulada



Volatilidade - 21 dias



Estatísticas

Início em 16/01/2023

Informação	No ano	6 Meses	12 Meses	Do início
Retorno Acumulado (%)	6,39	5,96	9,47	38,24
Volatilidade Média Anualizada (%)	9,23	6,26	4,59	3,05
Máximo Drawdown (%)	-0,98	-2,74	-2,74	-2,74
Meses Acima do Benchmark	2	4	7	20
Meses Abaixo do Benchmark	0	2	5	17
Índice Sharpe	0,50	0,70	0,99	2,06
Maior Retorno Mensal (%)	3,87	3,87	3,87	3,87
Menor Retorno Mensal (%)	2,43	-1,11	-1,11	-1,11
Patrimônio Líquido Médio (R\$ milhões)	92.954.669,50	101.058.756,96	100.947.295,84	70.110.174,20

Por produto (%)

Produtos	Percentual	Produtos	Percentual
Warren Multigestores MM	0,06	Outros	99,94
Ace Capital FIC de FIM	0,01		
SPX NIMITZ WARREN FIC FIM	0,01		
Absolute Vertex II FIC de FIM	-		
Mar Absoluto II FIC de FIM	-		
Giant Zarathustra II FIC de FIM	-		
Vista Hedge D30 FIC de FIM	-		
Vinland Macro FIC de FIM	-		
SPX HORNET EQUITY HEDGE FIC FIM	-		
AMW Omaha FIC FIM	-		
BEYOND SOBERANO FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM COTAS RF - REF DI RESP LIMITADA	-		
AMW Cash Clash FIRF LP	-		
Outros	0,02		

warren

Investimentos

Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 meses.

Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito.

Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos.

Caso o índice comparativo de rentabilidade utilizado neste material não seja o parâmetro objetivo do fundo (benchmark oficial), tal indicador é meramente utilizado como referência econômica.

Verifique se este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em perdas patrimoniais para seus quotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo.

Verifique se este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Este fundo pode estar exposto à significativa concentração em ativos de crédito de poucos emissores.

Para fundos que perseguem a manutenção de uma carteira de longo prazo, não há garantia de que o fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo.