

Fevereiro 2025

Warren FO Tático RV

Sobre o fundo

Início em 09/02/2022

O Warren FO Tático RV 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 aloca em ações brasileiras ou globais dependendo dos níveis de preços vigentes. Além disso, o fundo também tem mandato para a introdução de proteções na mesma classe quando o ambiente torna-se mais complexo. A alocação neutra do fundo - a alocação quando não há oportunidade identificada - é composta de 50% de RV Brasil e 50% em ações globais, sendo investido em índices passivos 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 ações Brasil (Ibovespa) e 50% de ações globais com efeito cambial.

Melhor mês
Ago/22

9,26%

Pior mês
Jun/22

-10,91%

Positivo/Neg.
12 meses

↗ 5

↘ 7

Benchmark Teórico
50% MSCI World + 50% Ibovespa

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% MSCI World + 50% Ibovespa

↗ 4

↘ 8

Meta de risco
15% a 25%

17,96%

Warren FO Tático RV

Para Todos Investidores

Principais mercados

Ações Brasil, Ações Globais

Categoria
Multimercados Livre

Gestor
Warren Brasil

CNPJ
44.763.378/0001-12

Administrador
Vortx

Custodiante

Auditoria
Deloitte Touche Tohmatsu

Taxa de administração
0,10%

Taxa de performance
0,00%

Tributação
15%

Aplicação inicial
R\$ 1,00

Movimentação mínima
R\$ 1,00

Patrimônio líquido
R\$ 9.504.726,87

Cotização da aplicação
D+0

Cotização do resgate
D+2

Pagamento do resgate
D+4

Benchmark
50% MSCI World + 50% Ibovespa

Exposição cambial
Não

Performance histórica (%)

■ Fundo ■ 50% MSCI World + 50% Ibovespa



Anos e Índices	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Início
2025	0,77	-0,82	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,06	2,52
Benchmark	1,04	-1,14	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,12	24,53
% Benchmark	74,16	71,99	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	50,47	10,28
2024	-4,56	0,68	-0,60	-1,37	-2,86	-0,15	1,89	4,24	-1,97	0,75	1,67	-1,75	-4,26	2,58
Benchmark	-1,47	2,85	1,88	-1,05	1,13	4,77	3,21	4,13	-2,10	1,22	2,90	-2,61	15,53	24,67
% Benchmark	311,27	23,68	-32,17	130,47	-253,17	-3,09	58,68	102,82	93,79	61,84	57,77	66,83	-27,42	10,46
2023	-0,56	-3,74	-3,66	1,19	2,63	1,42	0,85	-1,33	1,32	-1,95	5,15	5,77	6,81	7,14
Benchmark	3,26	-3,77	-1,80	1,22	2,16	4,17	3,12	-1,00	-1,75	-3,00	9,46	4,56	17,05	7,92
% Benchmark	-17,06	99,31	202,73	97,51	121,92	33,99	27,28	133,35	-75,51	65,04	54,44	126,63	39,92	90,22
2022	-	0,51	5,76	-9,03	4,03	-10,91	4,75	9,26	3,74	2,03	-5,24	-2,49	0,31	0,31
Benchmark	-	-2,39	-0,10	-7,47	-0,15	-5,44	5,27	1,20	-2,82	4,28	2,59	-2,29	-7,80	-7,80
% Benchmark	-	-21,20	-5.491,49	120,87	-2.729,96	200,62	90,03	771,97	-132,59	47,46	-202,51	108,71	-4,02	-4,02

Drawdown - Máxima perda acumulada

Fundo



Volatilidade - 21 dias

Fundo



Estatísticas

Início em 16/01/2023

Informação	No ano	6 Meses	12 Meses	Do início
Retorno Acumulado (%)	-0,06	-1,39	-0,41	2,52
Volatilidade Média Anualizada (%)	7,83	16,48	17,96	17,13
Máximo Drawdown (%)	-1,75	-8,70	-10,64	-18,87
Meses Acima do Benchmark	1	3	4	14
Meses Abaixo do Benchmark	1	3	8	23
Índice Sharpe	0,01	-0,03	-0,79	-1,28
Maior Retorno Mensal (%)	0,77	1,67	4,24	9,26
Menor Retorno Mensal (%)	-0,82	-1,97	-2,86	-10,91
Patrimônio Líquido Médio (R\$ milhões)	9.753.427,91	9.843.441,84	8.919.028,80	7.398.328,13

Por produto (%)

Produtos	Percentual
AMW Global FIC FIA - BDR Nivel I	8,74
AMW GLOBAL MASTER FIA BDR NÍVEL I	29,64
BEYOND SOBERANO FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM COTAS RF REF DI RESP LIMITADA	0,20
Outros	-21,10
AMW Cash Clash FIRF LP	2,77
Outros	2,77

Produtos	Percentual
AMW Tesouro SELIC FIRF	8,08
Outros	8,08
Outros	77,63

Produtos	Percentual
SANTANDER CASH BLUE FI RF REF DI	2,78
Outros	2,78

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.