

Warren FO Tático RF FIM CP

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 - 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.

Principais Mercados

Renda Fixa Pós
Renda Fixa Pré
Renda Fixa IPCA

Características

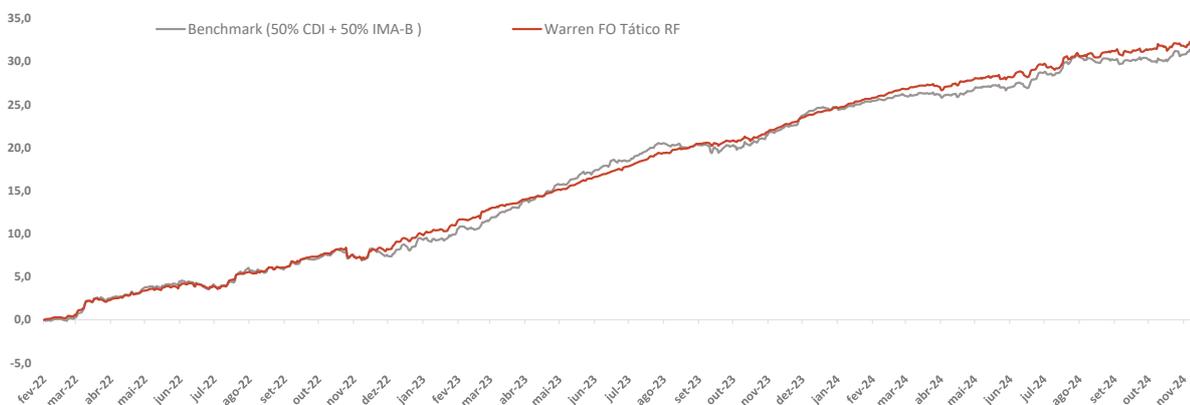
Categoria:	Multimercado - Estratégia Livre
CNPJ:	44.283.966/0001-59
Taxa de Gestão:	Não há
Taxa de Performance:	Não há
Gestor	Warren Family Office Gestão de rec. LTDA
Administrador	VORTX DTVM
Custodiante	VORTX DTVM
Auditoria	Deloitte Touche Tohmatsu
Benchmark	-----

Resultados Mensais

No mês de novembro, o Warren Tático RF performou -0,20% versus 0,41% do benchmark teórico. A renda fixa pública prefixada e indexada à inflação foram negativamente afetadas pela atividade local resiliente e, sobretudo, pela piora na percepção sobre o ambiente fiscal. No Comitê de Investimento de novembro, mantivemos os vieses levemente positivos inalterados, mas aproveitamos a piora recente para aumentar gradualmente nossa exposição aos títulos públicos prefixados de 30 para 35% da carteira. Continuamos com alocação em NTN-B 2026 e 2027 e LTN 2027/28 como principais posições do fundo.

Aplicação inicial:	R\$ 1,00
Movimentação mínima:	R\$ 1,00
Data de Início:	09/02/2022
Cotização de aplicação:	D+0
Cotização de resgate:	D+2 corridos
Pagamento de Resgate:	D+2 úteis
Tributação:	Longo Prazo
Público alvo:	Investidor Geral
Patrimônio Líquido	R\$ 100.548.450,42
Exposição Cambial	Não

Resultados Históricos (%)



	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago*	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2024	0,94	0,78	0,74	0,01	0,82	0,13	0,90	0,67	0,43	0,48	-0,20		5,84	31,38
Benchmark	0,82	0,70	0,80	0,34	0,94	0,59	0,91	0,69	0,08	0,14	0,41		6,62	31,03
2023	0,93	1,16	1,41	0,85	1,26	1,23	1,18	1,03	0,61	0,19	1,57	1,20	13,35	24,13
Benchmark	1,05	1,01	1,75	1,01	0,85	1,06	1,02	0,87	0,55	0,34	1,36	1,18	12,73	22,90
2022	0,28	1,82	0,70	0,84	0,47	0,37	1,21	1,12	1,08	1,08	-0,12	1,36	9,51	9,51
Benchmark	0,05	1,30	0,53	0,75	0,52	0,83	1,32	1,07	1,20	1,20	-0,16	1,26	9,01	9,01

*A partir do dia 01/08 adotamos o IMA-B como benchmark do fundo, em consonância com os modelos de alocação estrutural utilizados.

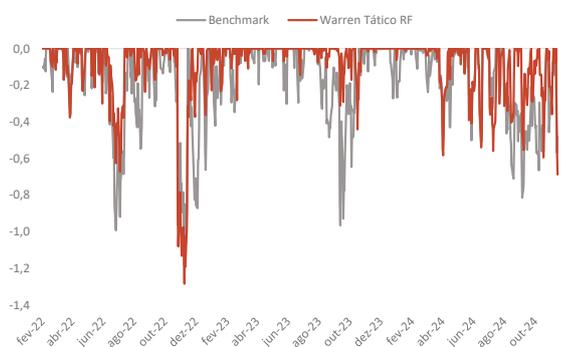
Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Leia o prospecto, o formulário de informações complementares, a minuta de informações essenciais e o regulamento antes de investir. 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. Para reclamações, favor contatar a Ouvidoria da Warren no email meajuda@warrenbrasil.com ou telefone (11) 4950-8124.



Alocação Alvo

	Neutro	Alocação Tática											
		dez/23	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24
Renda Fixa Pós	50	25,0	25,0	25,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Renda Fixa Pré	0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	30,0	30,0
Renda Fixa IPCA	50	25,0	25,0	25,0	50,0	50,0	75,0	75,0	75,0	75,0	75,0	70,0	70,0
Crédito Pós	0	25,0	25,0	25,0	25,0	25,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

Drawdown (%)



Volatilidade (%) - 21 dias



Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Leia o prospecto, o formulário de informações complementares, limina de informações essenciais e o regulamento antes de investir. 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. Para reclamações, favor contatar a Divisoria da Warren no email meajuda@warrenbrasil.com ou telefone (11) 4950-8124.