

# AMW Brasil FIA

## Objetivo do Fundo

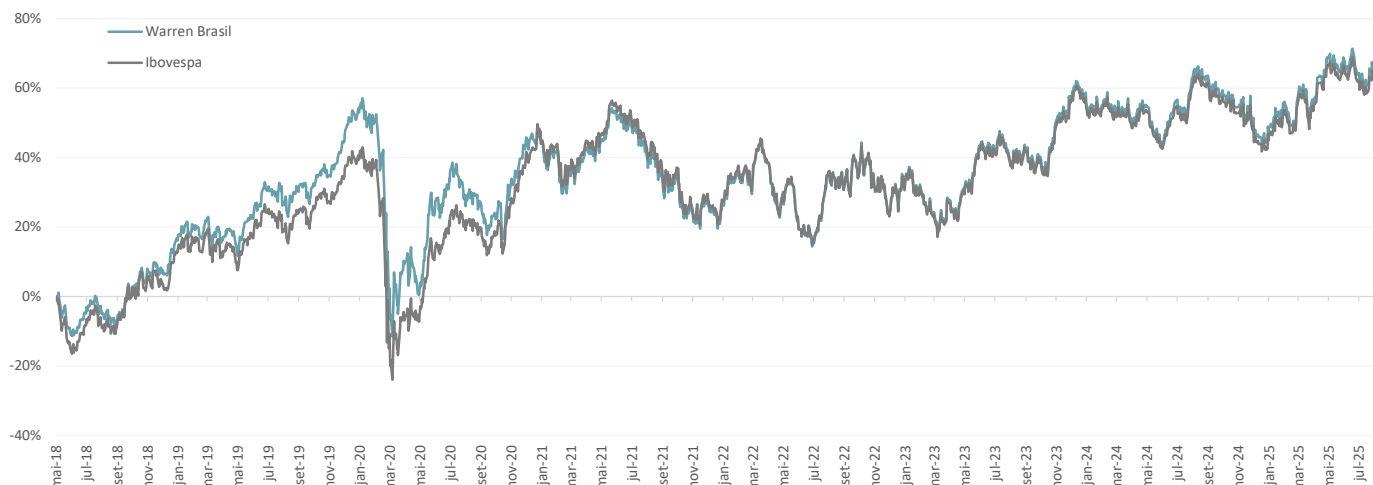
O Warren Brasil FIA possui como estratégia capturar o prêmio de risco de ações, seguindo o principal índice do país, o Ibovespa. O fundo adota uma estratégia indexada na bolsa brasileira, com um pequeno adicional sistemático, que visa suavizar movimentos de mercado.

## Características

|                        |                                                           |
|------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Categoria:             | Fundo de Investimento em Ações                            |
| CNPJ:                  | 29.577.652/0001-75                                        |
| Taxa de Administração: | 0,50% a.a                                                 |
| Taxa de Performance:   | Não há                                                    |
| Gestor                 | AMW Asset LTDA                                            |
| Administrador          | Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA |
| Custodiante            | Banco B3 S.A.                                             |
| Auditoria              | Ramires & Cia Auditores Independentes                     |
| Benchmark              | Ibovespa                                                  |
| Exposição Cambial      | Não                                                       |

|                         |                             |
|-------------------------|-----------------------------|
| Aplicação inicial:      | R\$ 1,00                    |
| Movimentação mínima:    | R\$ 1,00                    |
| Data de Início:         | 17/05/2018                  |
| Cotização de aplicação: | D+0                         |
| Cotização de resgate:   | D+0                         |
| Pagamento de Resgate:   | D+2 (úteis, após cotização) |
| Tributação:             | 15%                         |
| Público alvo:           | Investidor Geral            |
| Patrimônio Líquido      | R\$ 5.217.124,11            |

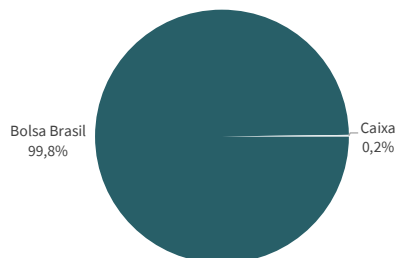
## Resultados Históricos



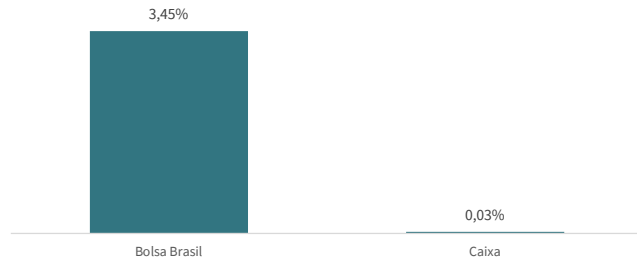
|             | Jan           | Fev           | Mar            | Abr            | Mai           | Jun            | Jul           | Ago           | Set           | Out           | Nov           | Dez           | Ano            | Acum.         |
|-------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| <b>2025</b> | <b>5,04%</b>  | <b>-2,57%</b> | <b>5,73%</b>   | <b>3,46%</b>   | <b>1,87%</b>  | <b>1,29%</b>   | <b>-4,39%</b> | <b>6,99%</b>  | <b>3,48%</b>  |               |               |               | <b>22,29%</b>  | <b>78,34%</b> |
| Ibov        | 4,86%         | -2,64%        | 6,08%          | 3,69%          | 1,45%         | 1,33%          | -4,17%        | 6,28%         | 3,40%         |               |               |               | 21,58%         | 74,88%        |
| <b>2024</b> | <b>-4,91%</b> | <b>1,00%</b>  | <b>-0,53%</b>  | <b>-1,51%</b>  | <b>-3,12%</b> | <b>1,46%</b>   | <b>3,17%</b>  | <b>6,93%</b>  | <b>-3,16%</b> | <b>-1,84%</b> | <b>-3,11%</b> | <b>-4,07%</b> | <b>-9,87%</b>  | <b>45,84%</b> |
| Ibov        | -4,79%        | 0,99%         | -0,71%         | -1,70%         | -3,04%        | 1,48%          | 3,02%         | 6,54%         | -3,08%        | -1,60%        | -3,12%        | -4,28%        | -10,36%        | 43,84%        |
| <b>2023</b> | <b>3,78%</b>  | <b>-7,81%</b> | <b>-2,62%</b>  | <b>2,45%</b>   | <b>4,00%</b>  | <b>8,87%</b>   | <b>3,27%</b>  | <b>-4,84%</b> | <b>0,73%</b>  | <b>-2,89%</b> | <b>12,66%</b> | <b>5,22%</b>  | <b>23,17%</b>  | <b>61,80%</b> |
| Ibov        | 3,37%         | -7,49%        | -2,91%         | 2,50%          | 3,74%         | 9,00%          | 3,27%         | -5,09%        | 0,71%         | -2,93%        | 12,54%        | 5,38%         | 22,28%         | 60,47%        |
| <b>2022</b> | <b>7,09%</b>  | <b>1,10%</b>  | <b>6,58%</b>   | <b>-10,85%</b> | <b>3,80%</b>  | <b>-11,40%</b> | <b>4,49%</b>  | <b>6,77%</b>  | <b>0,77%</b>  | <b>5,34%</b>  | <b>-3,17%</b> | <b>-2,47%</b> | <b>5,81%</b>   | <b>31,37%</b> |
| Ibov        | 6,98%         | 0,89%         | 6,06%          | -10,10%        | 3,22%         | -11,50%        | 4,69%         | 6,16%         | 0,47%         | 5,45%         | -3,06%        | -2,45%        | 4,69%          | 31,23%        |
| <b>2021</b> | <b>-6,09%</b> | <b>-5,01%</b> | <b>6,13%</b>   | <b>2,15%</b>   | <b>5,94%</b>  | <b>0,42%</b>   | <b>-3,99%</b> | <b>-2,65%</b> | <b>-6,33%</b> | <b>-6,38%</b> | <b>-1,10%</b> | <b>2,52%</b>  | <b>-14,51%</b> | <b>24,16%</b> |
| Ibov        | -3,32%        | -4,37%        | 6,00%          | 1,94%          | 6,16%         | 0,46%          | -3,94%        | -2,48%        | -6,57%        | -6,74%        | -1,53%        | 2,85%         | -11,93%        | 25,35%        |
| <b>2020</b> | <b>-1,05%</b> | <b>-7,42%</b> | <b>-27,17%</b> | <b>10,53%</b>  | <b>2,53%</b>  | <b>9,28%</b>   | <b>8,85%</b>  | <b>-6,40%</b> | <b>-5,95%</b> | <b>-2,14%</b> | <b>14,99%</b> | <b>8,47%</b>  | <b>-3,37%</b>  | <b>45,24%</b> |
| Ibov        | -1,63%        | -8,43%        | -29,90%        | 10,25%         | 8,57%         | 8,76%          | 8,27%         | -3,44%        | -4,80%        | -0,69%        | 15,90%        | 9,30%         | 2,92%          | 42,33%        |
| <b>2019</b> | <b>10,28%</b> | <b>-1,76%</b> | <b>-0,46%</b>  | <b>1,55%</b>   | <b>1,43%</b>  | <b>4,17%</b>   | <b>1,96%</b>  | <b>0,17%</b>  | <b>2,84%</b>  | <b>1,62%</b>  | <b>2,39%</b>  | <b>8,86%</b>  | <b>37,67%</b>  | <b>50,31%</b> |
| Ibov        | 10,82%        | -1,86%        | -0,18%         | 0,98%          | 0,70%         | 4,06%          | 0,84%         | -0,67%        | 3,57%         | 2,36%         | 0,95%         | 6,85%         | 31,58%         | 38,30%        |

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, lâmina 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 persegue 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](mailto:meajuda@warrenbrasil.com) ou telefone (11) 4950-8124.

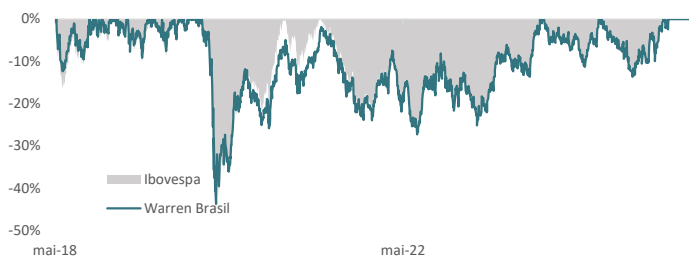
## Alocação Atual



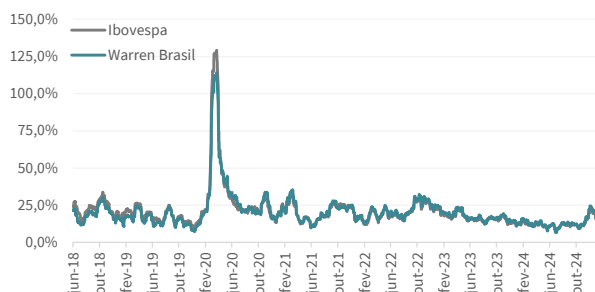
## Atribuição de Performance Mensal



## Drawdown



## Volatilidade - 21 dias



## Estatísticas

|                         | Ano     | 6 Meses | 12 Meses | Início  |
|-------------------------|---------|---------|----------|---------|
| Retorno Acumulado       | 22,29%  | 13,01%  | 11,57%   | 78,34%  |
| Volatilidade anualizada | 16,70%  | 15,81%  | 16,72%   | 26,64%  |
| Máximo Drawdown         | -13,64% | -9,91%  | -13,64%  | -43,70% |
| Meses acima Ibov        | 5       | 3       | 7        | 50      |
| Meses abaixo Ibov       | 4       | 3       | 5        | 39      |
| Índice Sharpe           | 0,86    | 0,55    | -0,10    | -0,02   |
| Maior Retorno mensal    | 6,99%   | 6,99%   | 6,99%    | 12,66%  |
| Menor Retorno mensal    | -4,39%  | -4,39%  | -4,39%   | -11,40% |
| PL médio                | 6,89M   | 6,62M   | 7,21M    | 26,66M  |

## Classificação de risco



## Comparativos

| Ano  | No Ano  |         |        | Acumulado |        |        |
|------|---------|---------|--------|-----------|--------|--------|
|      | Nominal | Ibov    | Ibov+  | Nominal   | Ibov   | Ibov+  |
| 2025 | 22,29%  | 21,58%  | 0,71%  | 78,34%    | 74,88% | 3,46%  |
| 2024 | -9,87%  | -10,36% | 0,49%  | 45,84%    | 43,84% | 2,00%  |
| 2023 | 23,17%  | 22,28%  | 0,88%  | 61,80%    | 60,47% | 1,34%  |
| 2022 | 5,81%   | 4,69%   | 1,12%  | 31,37%    | 31,23% | 0,14%  |
| 2021 | -14,51% | -11,93% | -2,58% | 24,16%    | 25,35% | -1,19% |
| 2020 | -3,37%  | 2,92%   | -6,29% | 45,24%    | 42,33% | 2,91%  |
| 2019 | 37,67%  | 31,58%  | 6,09%  | 50,31%    | 38,30% | 6,09%  |
| 2018 | 9,18%   | 5,10%   | 4,08%  | 9,18%     | 5,10%  | 4,08%  |

## Correlação

|          | W Brasil | Ibovespa | S&P 500 | Nasdaq | IMA-B | Dólar |
|----------|----------|----------|---------|--------|-------|-------|
| W Brasil | 1,00     |          |         |        |       |       |
| Ibovespa | 0,97     | 1,00     |         |        |       |       |
| S&P 500  | 0,64     | 0,62     | 1,00    |        |       |       |
| Nasdaq   | 0,57     | 0,56     | 0,94    | 1,00   |       |       |
| IMA-B    | 0,64     | 0,62     | 0,38    | 0,32   | 1,00  |       |
| Dólar    | -0,38    | -0,37    | -0,22   | -0,18  | -0,31 | 1,00  |