

# AMW Tesouro RF Selic Simples

## Objetivo do Fundo

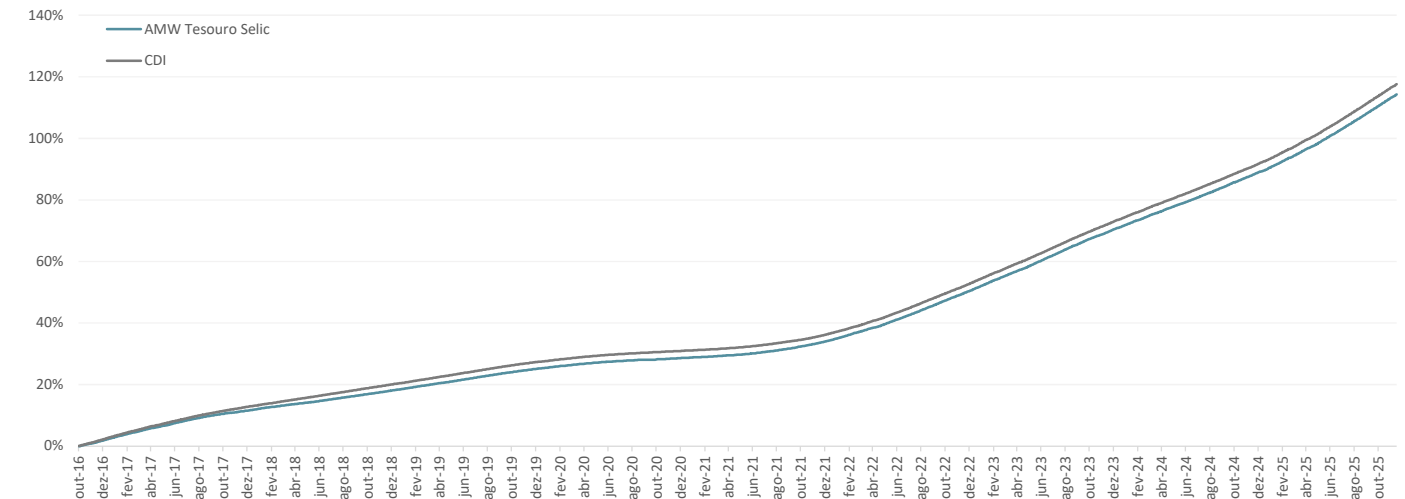
O Fundo AMW Tesouro Selic é o fundo mais conservador da casa. Um fundo DI aloca no mínimo 95% do seu patrimônio em títulos de renda fixa públicos atrelados a indexadores como a SELIC e o CDI, garantindo previsibilidade de retornos e baixo risco. Outra característica importante deste investimento é a sua liquidez diária. O investimento neste fundo é sugerido para investidores mais conservadores ou para objetivos de curtíssimo prazo.

## Características

|                        |                                     |
|------------------------|-------------------------------------|
| Categoria:             | Fundo de Investimento em Renda Fixa |
| CNPJ:                  | 24.986.670/0001-97                  |
| Taxa de Administração: | 0,15% a.a.                          |
| Taxa de Performance:   | Não há                              |
| Gestor                 | AMW Asset LTDA                      |
| Administrador          | BTG PSF                             |
| Custodiante            | BTG PSF                             |
| Auditoria              | Ernst & Young                       |
| Benchmark              | CDI                                 |
| Exposição Cambial      | Não                                 |

|                         |                             |
|-------------------------|-----------------------------|
| Aplicação inicial:      | R\$ 100,00                  |
| Movimentação mínima:    | R\$ 1,00                    |
| Data de Início:         | 13/10/2016                  |
| Cotização de aplicação: | D+0                         |
| Cotização de resgate:   | D+0 (corridos)              |
| Pagamento de Resgate:   | D+0 (úteis, após cotização) |
| Tributação:             | Longo Prazo com Come-Cotas  |
| Público alvo:           | Investidores Geral          |
| Patrimônio Líquido      | R\$ 58.380.206,07           |

## Resultados Históricos

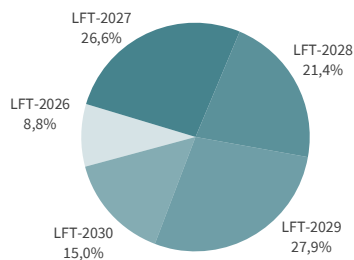


|             | Jan          | Fev          | Mar          | Abr          | Mai          | Jun          | Jul          | Ago          | Set          | Out          | Nov          | Dez          | Ano           | Acum.          |
|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|----------------|
| <b>2025</b> | <b>1,07%</b> | <b>0,98%</b> | <b>0,95%</b> | <b>1,03%</b> | <b>1,15%</b> | <b>1,09%</b> | <b>1,27%</b> | <b>1,15%</b> | <b>1,22%</b> | <b>1,28%</b> | <b>1,05%</b> |              | <b>12,94%</b> | <b>114,24%</b> |
| %CDI        | 105,62%      | 99,87%       | 98,74%       | 97,58%       | 100,86%      | 99,53%       | 99,61%       | 99,10%       | 99,77%       | 100,25%      | 99,69%       |              | 100,04%       | 97,18%         |
| <b>2024</b> | <b>0,97%</b> | <b>0,80%</b> | <b>0,85%</b> | <b>0,88%</b> | <b>0,81%</b> | <b>0,77%</b> | <b>0,91%</b> | <b>0,88%</b> | <b>0,85%</b> | <b>0,94%</b> | <b>0,82%</b> | <b>0,84%</b> | <b>10,84%</b> | <b>89,69%</b>  |
| %CDI        | 100,28%      | 99,53%       | 102,03%      | 99,56%       | 97,50%       | 98,27%       | 100,00%      | 101,90%      | 101,60%      | 101,81%      | 103,54%      | 90,73%       | 99,66%        | 96,82%         |
| <b>2023</b> | <b>1,13%</b> | <b>0,95%</b> | <b>1,15%</b> | <b>0,88%</b> | <b>1,18%</b> | <b>1,12%</b> | <b>1,05%</b> | <b>1,17%</b> | <b>1,00%</b> | <b>0,96%</b> | <b>0,89%</b> | <b>0,89%</b> | <b>13,09%</b> | <b>71,15%</b>  |
| %CDI        | 100,68%      | 103,04%      | 97,80%       | 95,99%       | 105,24%      | 104,58%      | 97,81%       | 102,81%      | 102,35%      | 96,44%       | 96,59%       | 99,56%       | 100,36%       | 96,48%         |
| <b>2022</b> | <b>0,79%</b> | <b>0,81%</b> | <b>0,92%</b> | <b>0,71%</b> | <b>1,06%</b> | <b>1,03%</b> | <b>1,03%</b> | <b>1,17%</b> | <b>1,09%</b> | <b>1,07%</b> | <b>1,01%</b> | <b>1,10%</b> | <b>12,45%</b> | <b>51,33%</b>  |
| %CDI        | 107,42%      | 108,31%      | 99,14%       | 85,23%       | 102,79%      | 102,02%      | 99,91%       | 100,61%      | 101,85%      | 104,70%      | 98,87%       | 97,58%       | 100,63%       | 95,61%         |
| <b>2021</b> | <b>0,15%</b> | <b>0,14%</b> | <b>0,22%</b> | <b>0,17%</b> | <b>0,25%</b> | <b>0,32%</b> | <b>0,40%</b> | <b>0,44%</b> | <b>0,46%</b> | <b>0,55%</b> | <b>0,59%</b> | <b>0,76%</b> | <b>4,53%</b>  | <b>34,58%</b>  |
| %CDI        | 99,43%       | 102,32%      | 109,33%      | 83,62%       | 92,45%       | 103,37%      | 112,92%      | 102,98%      | 103,94%      | 115,04%      | 101,16%      | 99,76%       | 103,07%       | 94,04%         |
| <b>2020</b> | <b>0,38%</b> | <b>0,29%</b> | <b>0,34%</b> | <b>0,28%</b> | <b>0,25%</b> | <b>0,22%</b> | <b>0,19%</b> | <b>0,16%</b> | <b>0,10%</b> | <b>0,14%</b> | <b>0,16%</b> | <b>0,17%</b> | <b>2,70%</b>  | <b>28,74%</b>  |
| %CDI        | 100,69%      | 97,76%       | 99,05%       | 98,87%       | 103,49%      | 101,32%      | 100,11%      | 99,81%       | 61,95%       | 87,68%       | 104,10%      | 106,37%      | 97,71%        | 92,69%         |
| <b>2019</b> | <b>0,53%</b> | <b>0,49%</b> | <b>0,46%</b> | <b>0,50%</b> | <b>0,53%</b> | <b>0,46%</b> | <b>0,56%</b> | <b>0,49%</b> | <b>0,47%</b> | <b>0,48%</b> | <b>0,39%</b> | <b>0,38%</b> | <b>5,88%</b>  | <b>25,35%</b>  |
| %CDI        | 97,74%       | 98,59%       | 97,97%       | 96,15%       | 97,45%       | 97,14%       | 98,47%       | 96,44%       | 100,75%      | 100,67%      | 101,32%      | 101,00%      | 98,46%        | 92,26%         |

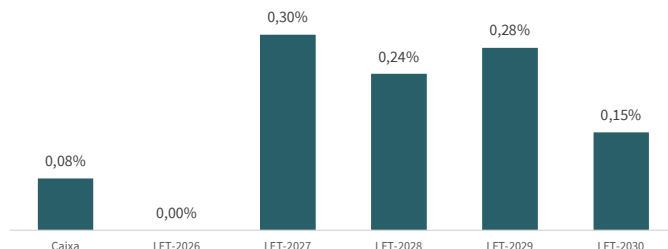
Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Rentabilidade passada não representa garantia 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 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](mailto:meajuda@warrenbrasil.com) ou telefone (11) 4950-8124.



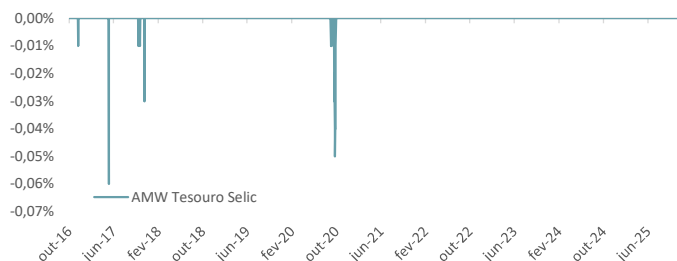
## Alocação Atual



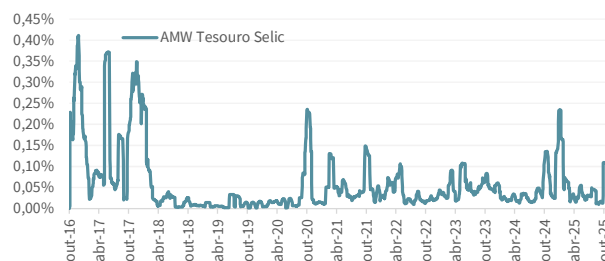
## Atribuição de Performance Mensal



## Drawdown



## Volatilidade - 21 dias



## Estatísticas

|                         | Ano    | 6 Meses | 12 Meses | Início  |
|-------------------------|--------|---------|----------|---------|
| Retorno Acumulado       | 12,94% | 7,27%   | 13,89%   | 114,24% |
| Volatilidade anualizada | 0,08%  | 0,05%   | 0,10%    | 0,21%   |
| Máximo Drawdown         | 0,00%  | 0,00%   | 0,00%    | -0,06%  |
| Meses acima do CDI      | 3      | 1       | 3        | 41      |
| Meses abaixo do CDI     | 8      | 5       | 9        | 69      |
| Índice Sharpe           | -0,16  | -1,52   | -1,17    | -1,70   |
| Maior Retorno mensal    | 1,28%  | 1,28%   | 1,28%    | 1,28%   |
| Menor Retorno mensal    | 0,95%  | 1,05%   | 0,84%    | 0,14%   |
| PL médio                | 63,7M  | 58,9M   | 65,6M    | 211,1M  |

## Classificação de risco



## Comparativos

| Ano  | No Ano  |         | Acumulado |        |
|------|---------|---------|-----------|--------|
|      | Nominal | %CDI    | Nominal   | %CDI   |
| 2025 | 12,94%  | 100,04% | 114,24%   | 97,18% |
| 2024 | 10,84%  | 99,66%  | 89,69%    | 96,82% |
| 2023 | 13,09%  | 100,36% | 71,15%    | 96,48% |
| 2022 | 12,45%  | 100,63% | 51,33%    | 95,61% |
| 2021 | 4,53%   | 103,07% | 34,58%    | 94,04% |
| 2020 | 2,70%   | 97,71%  | 28,74%    | 92,69% |
| 2019 | 5,88%   | 97,71%  | 25,35%    | 92,26% |
| 2018 | 5,85%   | 91,03%  | 18,40%    | 90,61% |
| 2017 | 9,16%   | 91,99%  | 11,86%    | 90,91% |
| 2016 | 2,47%   | 88,07%  | 2,47%     | 88,07% |

## Correlação

|          | T. Selic | Ibovespa | S&P 500 | Nasdaq | IMA-B | Dólar |
|----------|----------|----------|---------|--------|-------|-------|
| T. Selic | 1,00     |          |         |        |       |       |
| Ibovespa | 0,92     | 1,00     |         |        |       |       |
| S&P 500  | 0,76     | 0,70     | 1,00    |        |       |       |
| Nasdaq   | 0,76     | 0,70     | 1,00    | 1,00   |       |       |
| IMA-B    | 0,95     | 0,94     | 0,69    | 0,68   | 1,00  |       |
| Dólar    | -0,93    | -0,88    | -0,68   | -0,66  | -0,92 | 1,00  |