

Outubro 2025

Warren FO Tático RF FIF

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

↗ 9

↘ 3

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

↗ 8

↘ 4

Meta de risco
2% a 5%

4,89%

Warren FO Tático RF FIF

Público Geral

Principais mercados

Renda Fixa Pós, Renda Fixa Pré, Renda Fixa IPCA

Categoria
Multimercados Livre

Gestor
Warren Brasil

CNPJ
44.283.966/0001-59

Administrador
Vortx

Custodiante
Vortx

Auditoria
Deloitte Touche Tohmatsu

Taxa de administração
0,10%

Taxa de performance
0,00%

Tributação
Longo Prazo

Aplicação inicial
R\$ 1,00

Movimentação mínima
R\$ 1,00

Patrimônio líquido
R\$ 92.654.657,81

Cotização da aplicação
D+0

Cotização do resgate
D+2

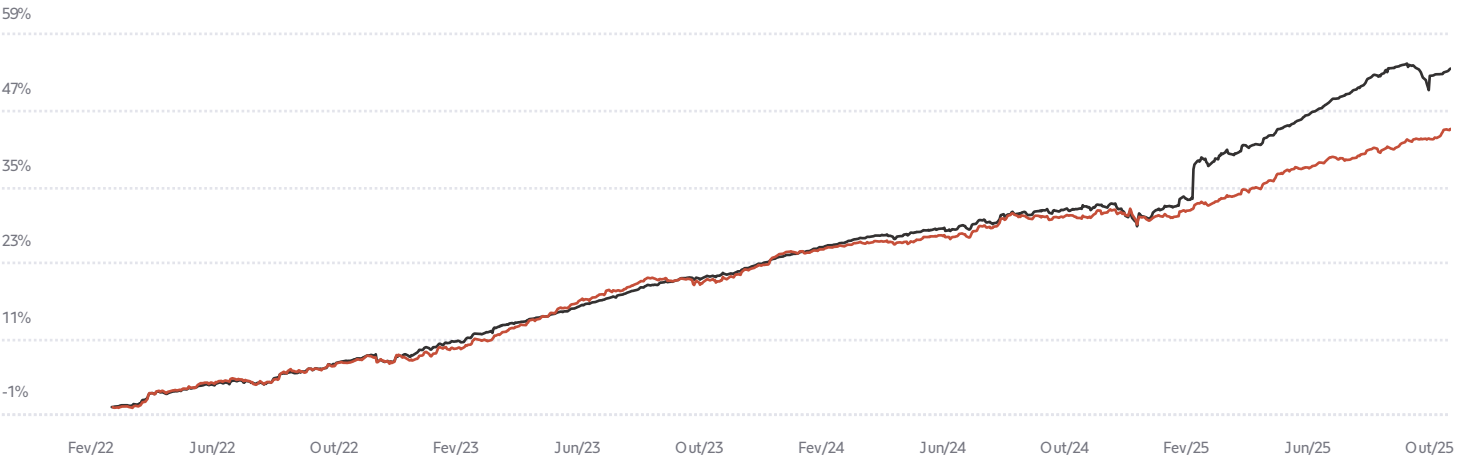
Pagamento do resgate
D+4

Benchmark
50% CDI + 50% IMA-B

Exposição cambial
Não

Performance histórica (%)

Fundo 50% CDI + 50% IMA-B

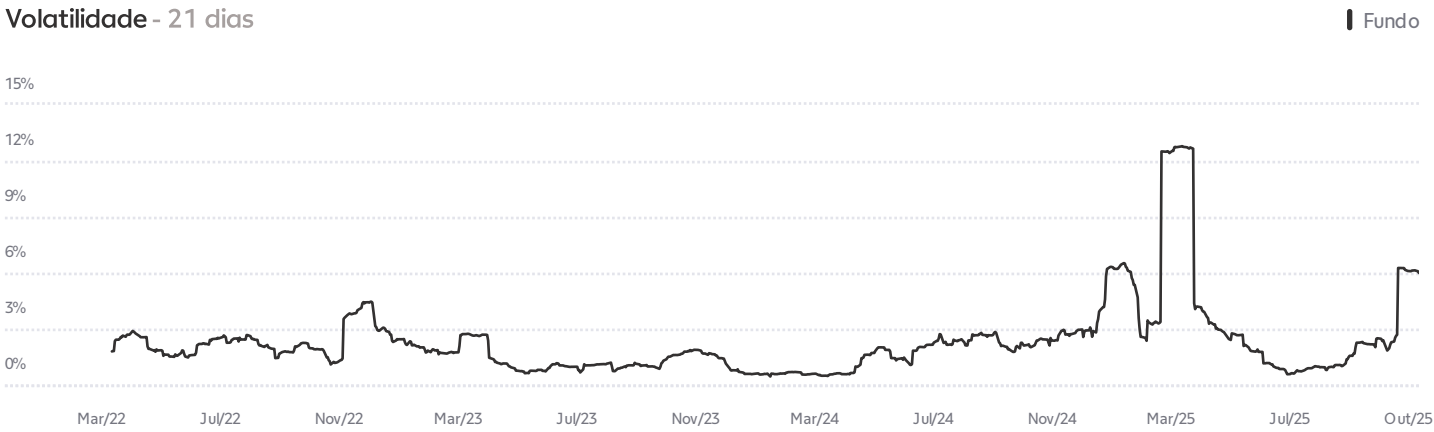


Anos e Índices	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Início
2025	2,43	3,87	1,59	1,87	1,67	1,97	1,56	2,07	-0,26	0,23	-	-	18,29	53,71
Benchmark	1,04	0,75	1,40	1,58	1,42	1,20	0,24	1,00	0,88	1,16	-	-	11,18	44,13
% Benchmark	232,73	517,90	113,38	118,40	117,99	164,40	656,71	207,03	-29,68	20,17	-	-	163,56	121,70
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 (%)	18,29	7,44	16,75	53,71
Volatilidade Média Anualizada (%)	4,85	2,82	4,89	3,02
Máximo Drawdown (%)	-2,73	-2,73	-2,74	-2,74
Meses Acima do Benchmark	8	4	8	26
Meses Abaixo do Benchmark	2	2	4	19
Índice Sharpe	1,47	0,50	1,24	3,17
Maior Retorno Mensal (%)	3,87	2,07	3,87	3,87
Menor Retorno Mensal (%)	-0,26	-0,26	-1,11	-1,11
Patrimônio Líquido Médio (R\$ milhões)	90.200.338,38	89.570.234,23	91.854.102,34	73.645.019,41

Por produto (%)

Produtos	Percentual	Produtos	Percentual	Produtos	Percentual
Warren PRO MASTER FIF	3,89	AMW Cash Clash FIRF LP	2,16	Outros	93,95
Gramado FIC FIDC - Subordinada	0,33	Outros	2,16		
AUGME PRO CLASSE DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CP - RESP LIMITADA	0,33				
More Crédito FIC FIDC	0,22				
BEYOND SOBERANO FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM COTAS RF REF DI RESP LIMITADA	0,17				
STRATEGI SINGLE NAME NPL FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,12				
LATACHE HIGH YIELD FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS NÃO PADRONIZADOS FIDC NP	0,10				
Anga Portfolio FIM CP	0,08				
VALORA HORIZON HIGH YIELD FIC DE FIM CP	0,08				
ANGÁ CRÉDITO ESTRUTURADO FIC FIF0,08 MULTI CP RESP LIMITADA	0,08				
BOCOM BBM CORPORATE CREDIT PLUS FIF - CIC MULT CRED PRIV - RESP LIMITADA	0,07				
M8 Credit Strategy Plus FIC FIM	0,03				
LAW FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL	0,02				
Outros	2,26				

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.