

W. Ísis FIC FIM CP

O fundo Warren Ísis FIC FIM CP é o fundo de crédito estruturado da Warren Asset. A estratégia tem como foco obter exposição a fundos de investimento em direitos creditórios (FIDCs e FIC FIDCs). O fundo também investe em fundos abertos que investem em crédito estruturado.

Principais Fatores

Crédito Estruturado

Características

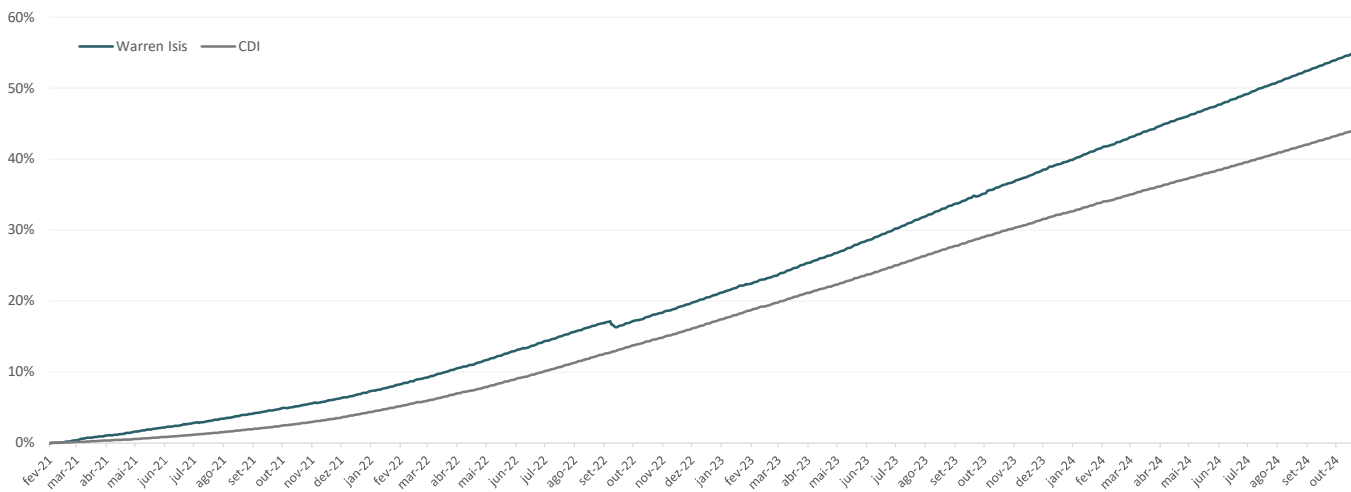
Categoria:	Fundo de Investimento em Cotas Multimercado Crédito Privado
CNPJ:	37.282.459/0001-35
Taxa de Administração:	0,6% a.a
Taxa de Performance:	20% sobre o CDI
Gestor	Warren Brasil Gestão e Administração de Recursos LTDA
Administrador	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Custodiante	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Auditoria	PWC
Benchmark	CDI
Exposição Cambial	Não

Resultados Mensais

Em outubro, o AMW Ísis rendeu 1,07%, equivalente a 115,0% do CDI.
No ano, o fundo alcançou uma rentabilidade de 11,23%, equivalente a 123,7% do CDI.
Em 12 meses, o fundo teve resultado de 13,72%, equivalente a 123,4% do CDI.
O fundo de crédito privado para investidor qualificado, aloca atualmente sua maior parcela em crédito estruturado. A carteira está majoritariamente alocada em FIDCs, sendo que os FIDCs Consignados Público, correspondem por, aproximadamente, 37% do desempenho mensal do fundo, seguido por em torno de 27% em FIDC Multicendente e Multisacado. A carteira de crédito permanece saudável.

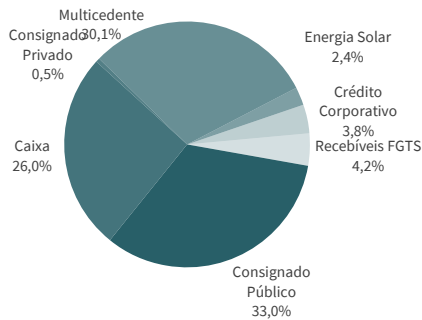
Aplicação inicial:	R\$ 1,00
Movimentação mínima:	R\$ 1,00
Data de Início:	08/02/2021
Cotização de aplicação:	D+0
Cotização de resgate:	D+90 (corridos)
Pagamento de Resgate:	D+2 (úteis, após cotização)
Tributação:	Longo Prazo com Come-Cotas
Público alvo:	Investidores Qualificados
Patrimônio Líquido	R\$ 31.386.903,16
Patrimônio Líquido do Master	R\$ 78.287.204,48

Resultados Históricos

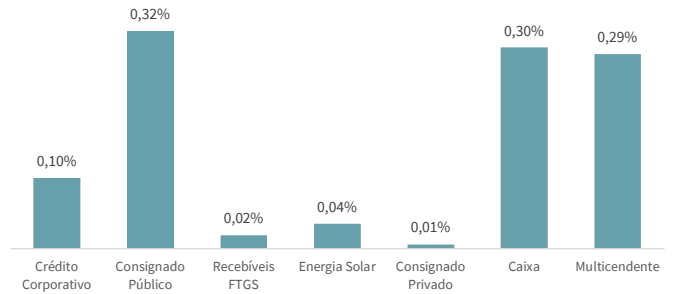


	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2024	1,22%	1,01%	1,04%	1,14%	1,03%	0,99%	1,16%	1,05%	1,01%	1,07%			11,23%	55,21%
%CDI	126,23%	125,43%	124,36%	128,03%	123,46%	125,90%	127,23%	120,45%	120,62%	115,04%			123,65%	119,98%
2023	1,18%	0,91%	1,38%	1,09%	1,35%	1,30%	1,31%	1,39%	1,07%	1,31%	1,13%	1,09%	15,50%	39,54%
%CDI	104,64%	98,69%	116,99%	118,72%	120,37%	120,83%	122,40%	121,74%	109,89%	130,68%	122,60%	122,05%	117,51%	118,85%
2022	0,87%	0,92%	1,12%	1,01%	1,24%	1,14%	1,15%	1,19%	0,14%	1,11%	1,09%	1,18%	12,85%	20,81%
%CDI	118,36%	122,72%	121,66%	120,63%	119,93%	112,47%	110,78%	101,68%	13,57%	109,01%	106,53%	104,94%	103,65%	119,87%
2021		0,21%	0,69%	0,52%	0,61%	0,57%	0,63%	0,69%	0,65%	0,66%	0,73%	0,88%	7,05%	7,05%
%CDI		230,49%	349,41%	252,20%	228,03%	185,34%	176,79%	162,23%	148,52%	136,86%	123,97%	115,02%	165,93%	165,93%

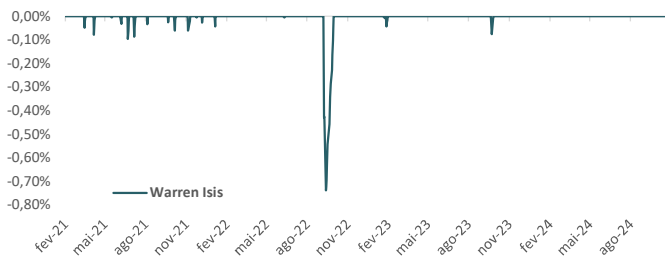
Alocação Atual



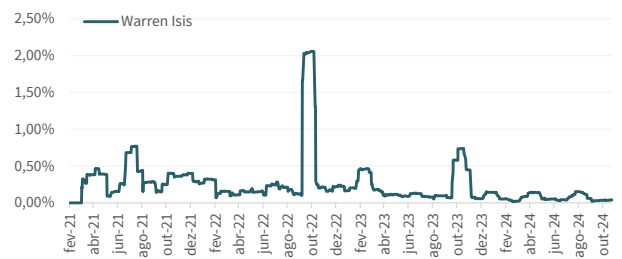
Atribuição de Performance Mensal



Drawdown



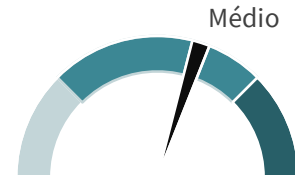
Volatilidade - 21 dias



Estatísticas

	Ano	6 Meses	12 Meses	Início
Retorno Acumulado	11,23%	6,47%	13,72%	55,21%
Volatilidade anualizada	0,10%	0,08%	0,10%	0,44%
Máximo Drawdown	-0,74%	0,00%	0,00%	-0,74%
Meses acima CDI	10	6	12	43
Meses abaixo CDI	0	0	0	2
Índice Sharpe	27,06	28,98	24,84	4,47
Maior Retorno mensal	1,22%	1,16%	1,22%	128,03%
Menor Retorno mensal	0,99%	0,99%	0,99%	0,90%
PL médio	29,2M	28,84M	29,5M	42,02M

Risco



Comparativos

Ano	No Ano			Acumulado		
	Nominal	%CDI	CDI+	Nominal	%CDI	CDI+
2024	11,23%	123,65%	2,44%	55,21%	119,98%	1,99%
2023	15,50%	117,51%	2,20%	39,54%	118,85%	1,85%
2022	12,85%	103,65%	0,43%	20,81%	119,87%	1,67%
2021	7,05%	165,93%	3,08%	7,05%	165,93%	3,08%

Correlação

	Warren Ísis	Ibovespa	S&P 500	Nasdaq	IMA-B	Dólar
Warren Ísis	1,00					
Ibovespa	-0,01	1,00				
S&P 500	0,02	0,62	1,00			
Nasdaq	0,00	0,56	0,94	1,00		
IMA-B	0,04	0,62	0,38	0,32	1,00	
Dólar	-0,01	-0,37	-0,22	-0,18	-0,31	1,00