

AMW Cash Clash

O fundo AMW Cash Clash tem uma estratégia que busca retorno preponderantemente através de exposição tática no mercado de LFT's e demais ativos de alta liquidez com risco soberano, com pequena parcela de exposição à crédito bancário com excelente nível de risco. O fundo busca entregar liquidez, segurança e rentabilidade ao investidor através de uma exposição com baixa volatilidade.

Principais Fatores

Liquidez

Crédito

Características

Categoria:	Fundo de Investimento em Renda Fixa
CNPJ:	42.550.188/0001-91
Taxa de Administração:	0,18% a.a
Taxa de Performance:	10% sobre o CDI
Gestor	AMW Asset LTDA
Administrador	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Custodiante	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Auditoria	Ernst & Young
Benchmark	CDI
Exposição Cambial	Não

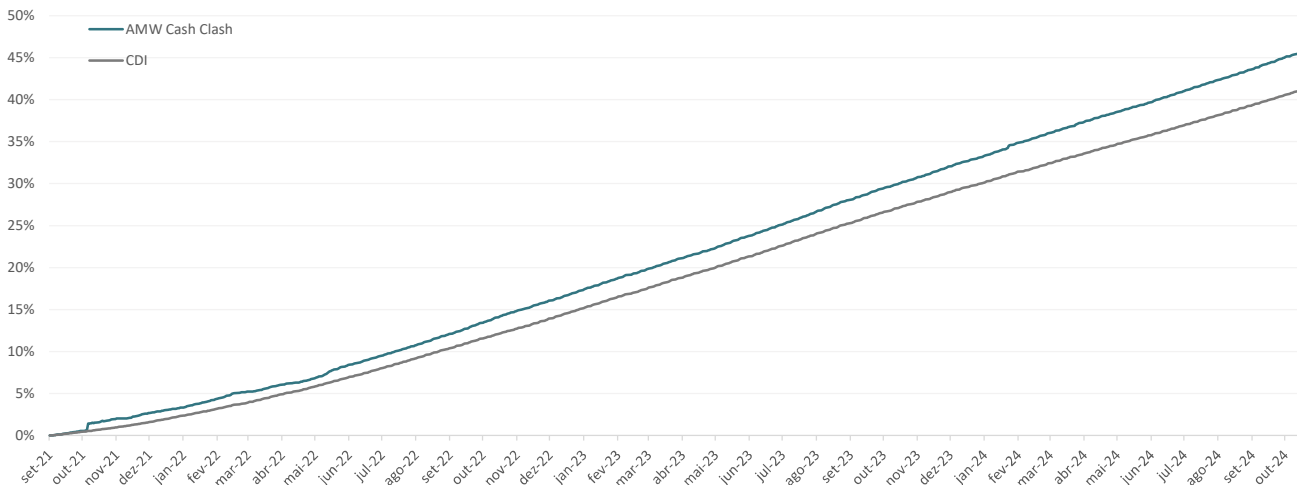
Resultados Mensais

Em outubro, o fundo AMW Cash Clash rendeu 0,92%, equivalente a 99,7% do CDI. Em 12 meses, o fundo teve resultado de 11,94%, equivalente a 108,3% do CDI.

O desempenho abaixo do CDI é explicado pela abertura de taxas de crédito bancário high grade, que representam 20% do fundo. Nossa estratégia de LFT acabou compensando positivamente boa parte do movimento. Na margem, temos reduzido os prazos dos títulos de nossa carteira, priorizando a liquidez em um mercado com taxas cada vez mais fechadas.

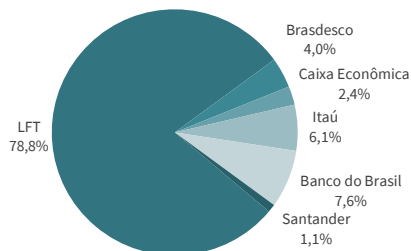
Aplicação inicial:	R\$ 1,00
Movimentação mínima:	R\$ 1,00
Data de Início:	10/09/2021
Cotização de aplicação:	D+0
Cotização de resgate:	D+0 (corridos)
Pagamento de Resgate:	D+0 (úteis, após cotização)
Tributação:	Longo Prazo com Come-Cotas
Público alvo:	Investidores Geral
Patrimônio Líquido	R\$ 798.408.379,00

Resultados Históricos

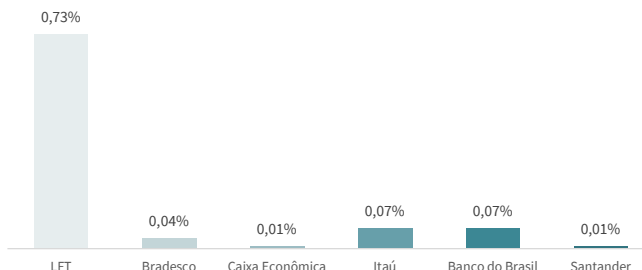


	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2024	1,03%	1,04%	0,86%	0,99%	0,85%	0,86%	0,99%	0,89%	0,92%	0,92%			9,77%	45,86%
%CDI	106,66%	129,30%	103,76%	111,52%	102,19%	109,12%	109,59%	102,53%	110,51%	99,25%			108,24%	108,91%
2023	1,15%	0,95%	1,17%	0,92%	1,20%	1,12%	1,10%	1,26%	1,01%	1,00%	1,02%	0,94%	13,63%	32,88%
%CDI	102,53%	103,40%	99,35%	100,44%	106,89%	104,66%	102,22%	110,81%	103,44%	100,50%	110,83%	105,35%	104,19%	109,13%
2022	0,81%	1,01%	0,70%	0,66%	1,40%	1,09%	1,06%	1,25%	1,21%	1,22%	1,08%	1,10%	13,35%	16,94%
%CDI	110,18%	134,83%	76,05%	79,06%	135,77%	107,74%	102,69%	106,77%	113,26%	119,59%	106,18%	97,50%	107,43%	113,51%
2021									0,37%	1,34%	0,65%	0,78%	3,17%	3,17%
%CDI									123,47%	277,43%	110,93%	101,67%	146,95%	146,95%

Alocação Atual



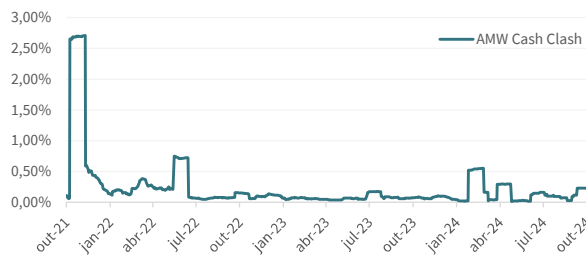
Atribuição de Performance Mensal



Drawdown



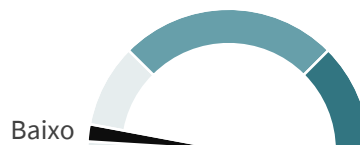
Volatilidade - 21 dias



Estatísticas

	Ano	6 Meses	12 Meses	Início
Retorno Acumulado	9,77%	5,56%	11,93%	45,86%
Volatilidade anualizada	0,23%	0,14%	0,21%	0,49%
Máximo Drawdown	-0,05%	0,00%	0,00%	-0,05%
Meses acima CDI	9	5	11	33
Meses abaixo CDI	1	1	1	5
Índice Sharpe	3,69	3,89	3,99	1,96
Maior Retorno mensal	1,04%	0,99%	1,04%	1,40%
Menor Retorno mensal	0,85%	0,85%	0,85%	0,66%
PL médio	684,18M	729,83M	684,18M	398,09M

Risco



Estatísticas

Ano	No Ano			Acumulado		
	Nominal	%CDI	CDI+	Nominal	%CDI	CDI+
2024	9,77%	108,24%	0,84%	45,86%	108,91%	0,99%
2023	13,63%	104,19%	0,52%	32,88%	109,13%	1,04%
2022	13,35%	107,43%	0,87%	16,94%	113,51%	1,44%
2021	3,17%	146,95%	3,32%	3,17%	146,95%	3,32%

Correlação

	Cash Clash	Ibovespa	S&P 500	Nasdaq	IMA-B	Dólar
Cash Clash	1,00					
Ibovespa	0,10	1,00				
S&P 500	0,05	0,62	1,00			
Nasdaq	0,03	0,56	0,94	1,00		
IMA-B	-0,10	0,62	0,38	0,32	1,00	
Dólar	-0,12	-0,37	-0,22	-0,18	-0,31	1,00