

AMW IPCA Curto

O AMW IPCA Curto é um fundo de renda fixa simples que investe no mínimo 95% de seu patrimônio em títulos do governo federal indexados à inflação (Tesouro IPCA). O fundo não tem exposição ao crédito privado, tornando seu risco essencialmente soberano.

Principais Fatores

Juro Real

Características

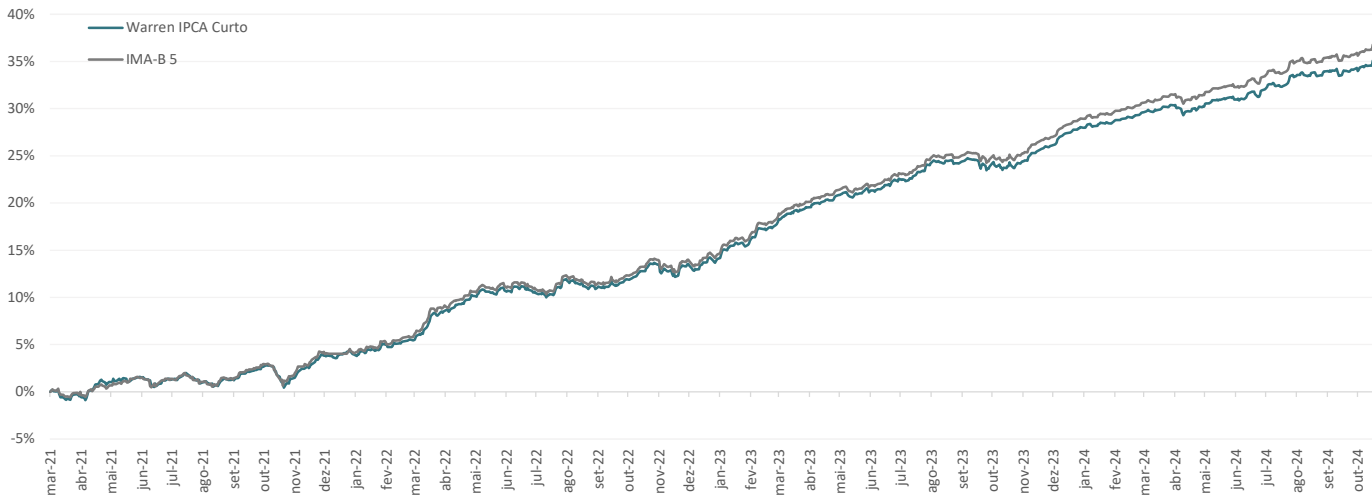
Categoria:	Fundo de Investimento em Renda Fixa
CNPJ:	37.557.820/0001-99
Taxa de Administração:	0,25% a.a
Taxa de Performance:	Não há
Gestor	AMW Asset LTDA
Administrador	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Custodiante	Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA
Auditoria	PWC
Benchmark	IMA-B 5
Exposição Cambial	Não

Resultados Mensais

Em outubro, o fundo AMW IPCA rendeu 0,67%. Em 12 meses, o fundo teve resultado de 8,99%. No mês, os títulos mais curtos tiveram resultados positivos influenciados pela elevação das inflações implícitas. Entretanto, conforme é aumentado o prazo de vencimento dos títulos, pior foi o desempenho. Essa piora é devida ao aumento dos prêmios devido às incertezas fiscais atuais.

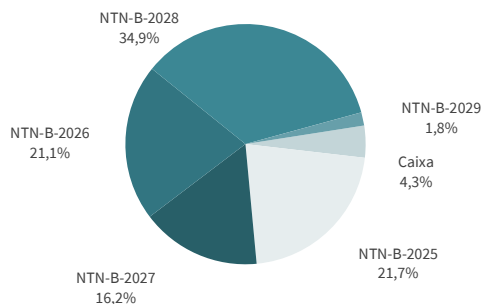
Aplicação inicial:	R\$ 1,00
Movimentação mínima:	R\$ 1,00
Data de Início:	09/03/2021
Cotização de aplicação:	D+0
Cotização de resgate:	D+0 (corridos)
Pagamento de Resgate:	D+2 (úteis, após cotização)
Tributação:	Longo Prazo com Come-Cotas
Público alvo:	Investidor Geral
Patrimônio Líquido	R\$ 26.567.637,51

Resultados Históricos

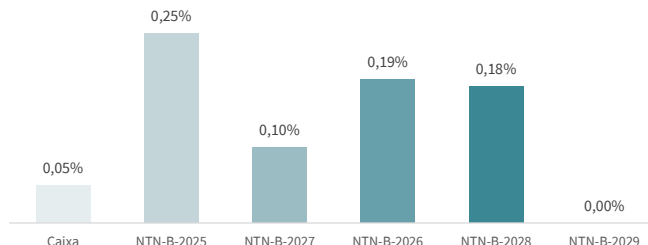


	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2024	0,62%	0,57%	0,72%	-0,32%	1,02%	0,31%	0,90%	0,57%	0,32%	0,67%			5,52%	34,81%
IMAB5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	0,91%	0,59%	0,40%	0,74%			6,08%	36,48%
2023	1,38%	1,39%	1,52%	0,88%	0,65%	1,01%	0,95%	0,59%	0,03%	-0,40%	1,79%	1,47%	11,83%	27,76%
IMAB5	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	0,97%	0,61%	0,13%	-0,31%	1,80%	1,46%	12,13%	28,65%
2022	0,58%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,91%	-0,33%	0,94%	10,30%	14,74%
IMAB5	0,58%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,91%	-0,33%	0,94%	10,30%	14,74%
2021			-0,37%	1,53%	0,27%	-0,19%	0,32%	-0,08%	0,86%	-1,84%	2,89%	0,85%	4,23%	4,23%
IMAB5			-0,20%	0,87%	0,69%	-0,13%	0,03%	0,15%	1,00%	-1,24%	2,50%	0,31%	4,03%	4,03%

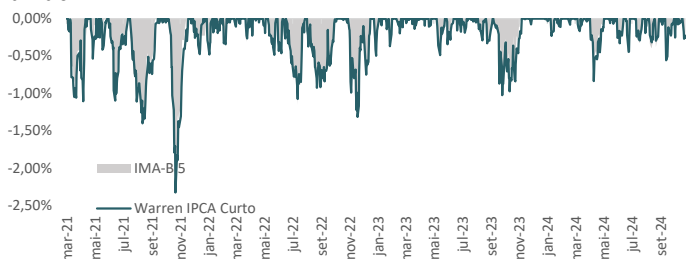
Alocação Atual



Atribuição de Performance Mensal



Drawdown



Volatilidade - 21 dias



Estatísticas

	Ano	6 Meses	12 Meses	Início
Retorno Acumulado	5,52%	3,85%	8,99%	34,81%
Volatilidade anualizada	2,15%	1,83%	1,64%	2,35%
Máximo Drawdown	-2,32%	-0,56%	-0,83%	-2,32%
Meses acima do IMA-B 5	0	0	1	12
Meses abaixo IMA-B 5	10	6	11	32
Índice Sharpe	-2,30	-1,66	-1,10	-0,78
Maior Retorno mensal	1,02%	1,02%	1,79%	2,89%
Menor Retorno mensal	-0,32%	0,31%	-0,32%	-1,84%
PL médio	31,28M	30,82M	31,45M	30,07M

Risco



Comparativos

Ano	No Ano			Acumulado		
	Nominal	IMAB-5	IMAB-5+	Nominal	IMAB-5	IMA-B 5+
2024	5,52%	6,08%	-0,63%	34,81%	36,48%	-0,34%
2023	11,83%	12,13%	-0,27%	27,76%	28,65%	-0,25%
2022	10,30%	10,30%	-0,63%	14,74%	14,74%	-0,24%
2021	4,23%	4,03%	0,24%	4,23%	4,03%	0,24%

Correlação

	WIPCA	Ibovespa	S&P 500	Nasdaq	IMA-B	Dólar
WIPCA	1,00					
Ibovespa	0,08	1,00				
S&P 500	0,06	0,62	1,00			
Nasdaq	0,07	0,56	0,94	1,00		
IMA-B	0,23	0,62	0,38	0,32	1,00	
Dólar	-0,12	-0,37	-0,22	-0,18	-0,31	1,00