

Índices da carteira

Mês/Ano

06/2023

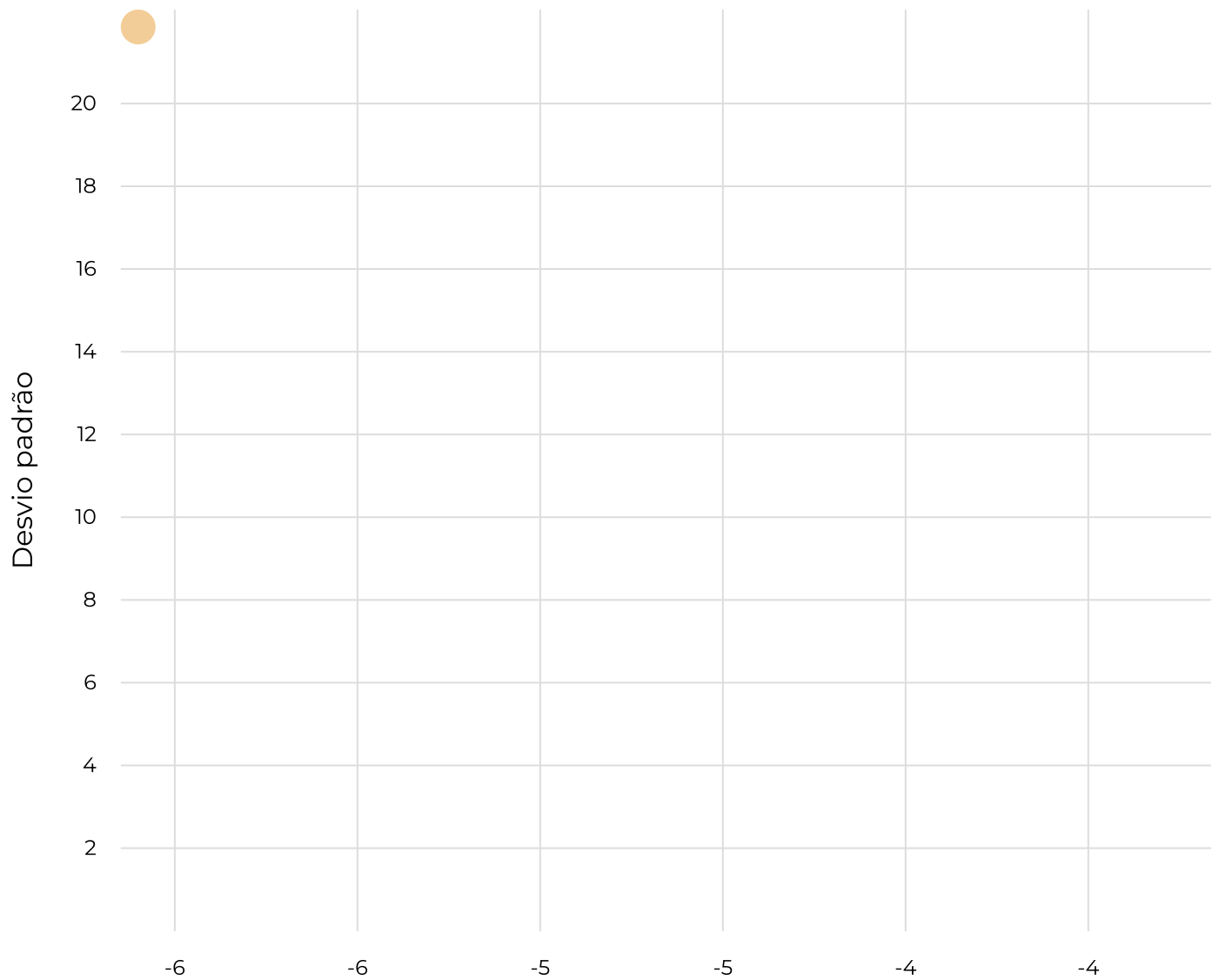


Imprimir

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	26,275542%	0,000060%	56,782207%	3,7359959
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,266854%	0,005548%	53,867944%	3,5442519
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,373008%	0,000128%	61,044897%	4,0164599
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	26,253432%	0,000099%	61,587867%	4,0521849
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,248775%	0,004007%	61,006107%	4,0139079
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,488617%	0,000055%	53,075299%	3,492098
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-	IRF-M 1	26,261737%	0,000129%	61,748904%	4,062780

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA					
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	26,286701%	0,000121%	61,560276%	4,050369
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-27,918684%	1,772736%	332,088536%	21,849822
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-7,665293%	0,000788%	6,279090%	0,413134%
NTN-B20450515	NTN-B	19,834047%	0,070018%	65,740416%	4,325402
NTN-C 20310101	NTN-C	-30,038456%	0,028984%	85,449843%	5,622187%

Rentabilidade x Desvio padrão

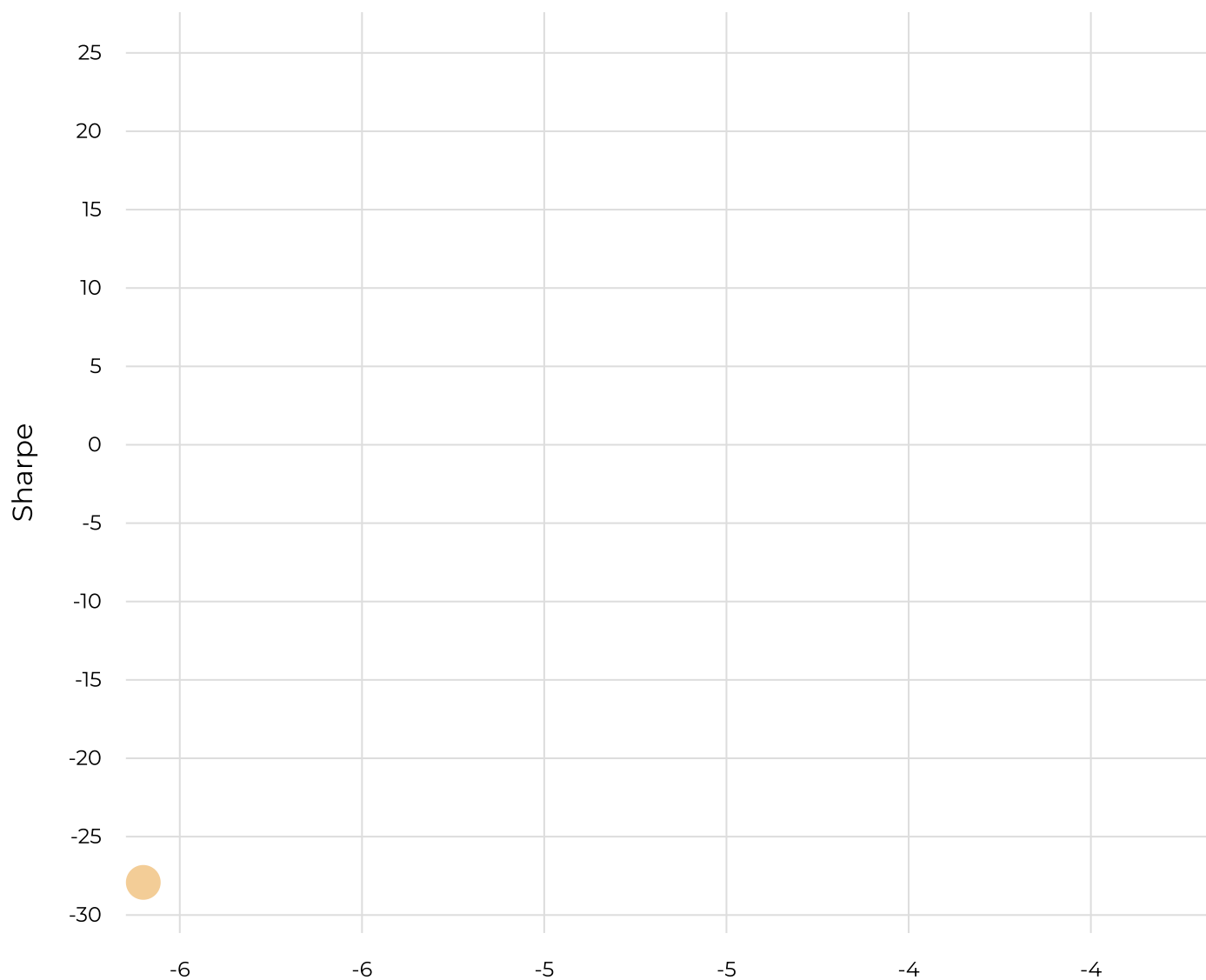


Rentabilidade x Sharpe

Por Benchmark

CDI

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE	CDI	26,275542%	0,000060%	56,782207%	3,735995%



Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDOS DE INVESTIMENTO					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	26,253432%	0,000099%	61,587867%	4,052184%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,488617%	0,000055%	53,075299%	3,492098%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL	CDI	26,286701%	0,000121%	61,560276%	4,050369%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO					

IDKA 2

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,266854%	0,005548%	53,867944%	3,544251%

IRF-M 1

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M 1	26,373008%	0,000128%	61,044897%	4,016459%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,261737%	0,000129%	61,748904%	4,062780%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,248775%	0,004007%	61,006107%	4,013907%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-27,918684%	1,772736%	332,088536%	21,849822%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-7,665293%	0,000788%	6,279090%	0,413134%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	19,834047%	0,070018%	65,740416%	4,325402%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	-30,038456%	0,028984%	85,449843%	5,622187%

Por artigo

Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE	CDI	26,275542%	0,000060%	56,782207%	3,735995%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDOS DE INVESTIMENTO					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	26,253432%	0,000099%	61,587867%	4,052184%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	26,286701%	0,000121%	61,560276%	4,050369%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-27,918684%	1,772736%	332,088536%	21,849822%

Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,266854%	0,005548%	53,867944%	3,544251%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,373008%	0,000128%	61,044897%	4,016459%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,248775%	0,004007%	61,006107%	4,013907%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL	CDI	26,488617%	0,000055%	53,075299%	3,492098%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES					
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,261737%	0,000129%	61,748904%	4,062780%

Res. 4.963/2021 - FIDC Sênior - Art. 7º, V, "a"

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-7,665293%	0,000788%	6,279090%	0,413134%

Res. 4.963/2021 - Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	19,834047%	0,070018%	65,740416%	4,325402%
NTN-C 20310101	NTN-C	-30,038456%	0,028984%	85,449843%	5,622187%