

Índices da carteira

Mês/Ano

05/2023

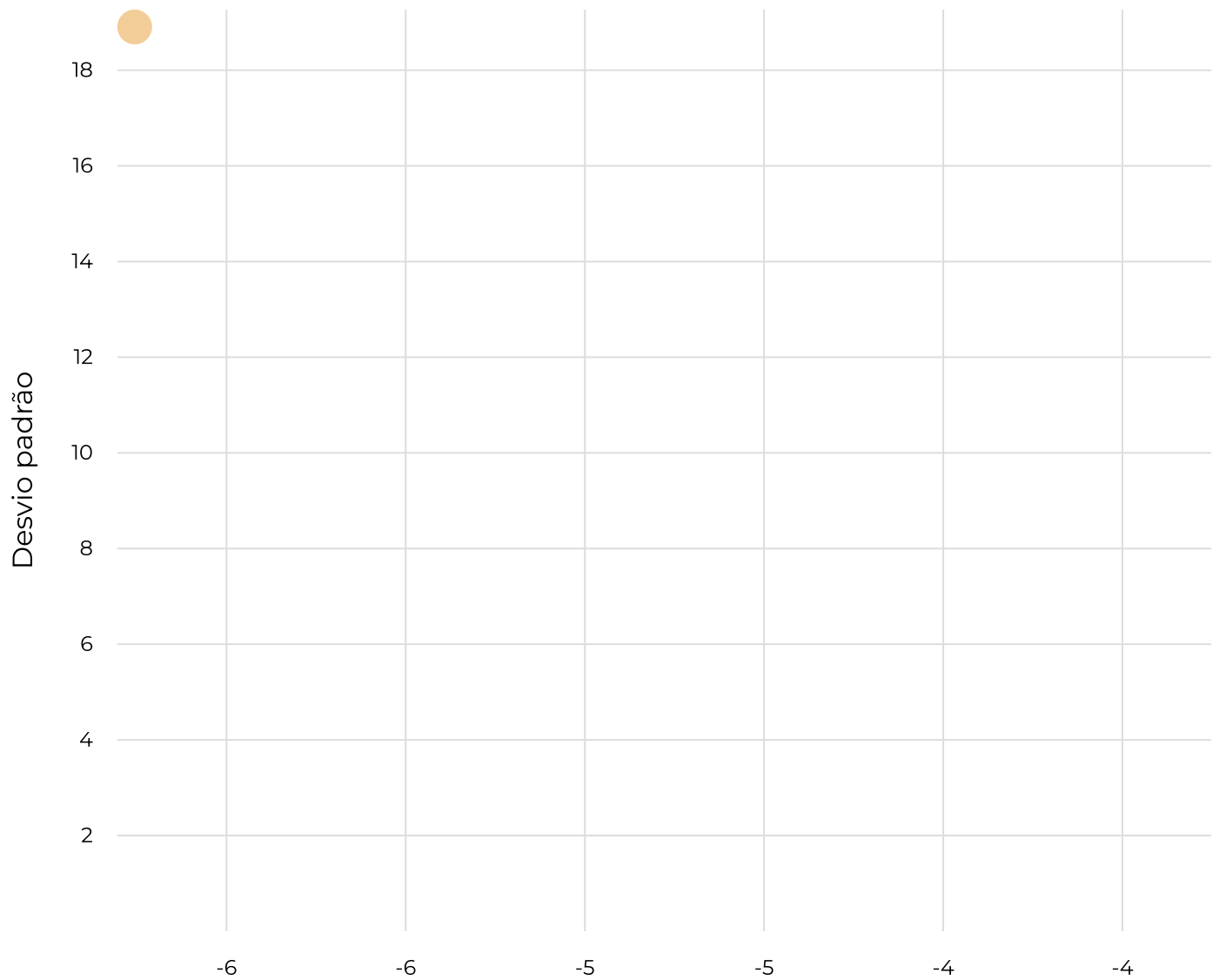


Imprimir

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	26,093857%	0,000062%	56,615445%	3,741254%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	20,995097%	0,005652%	49,799562%	3,290848%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,907682%	0,000133%	60,701096%	4,011241%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	26,046047%	0,000099%	61,486294%	4,063129%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,384287%	0,004220%	56,303596%	3,720646%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,219862%	0,000053%	52,845093%	3,492102%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-	IRF-M 1	25,806074%	0,000138%	61,354469%	4,054417%

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	26,151990%	0,000119%	61,344970%	4,053790
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-33,095369%	1,757686%	286,063642%	18,903618
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	6,849802%	0,000746%	5,510266%	0,3641299
NTN-B20450515	NTN-B	12,550300%	0,066410%	49,481281%	3,269815%
NTN-C 20310101	NTN-C	-26,531713%	0,033478%	89,354069%	5,904683

Rentabilidade x Desvio padrão

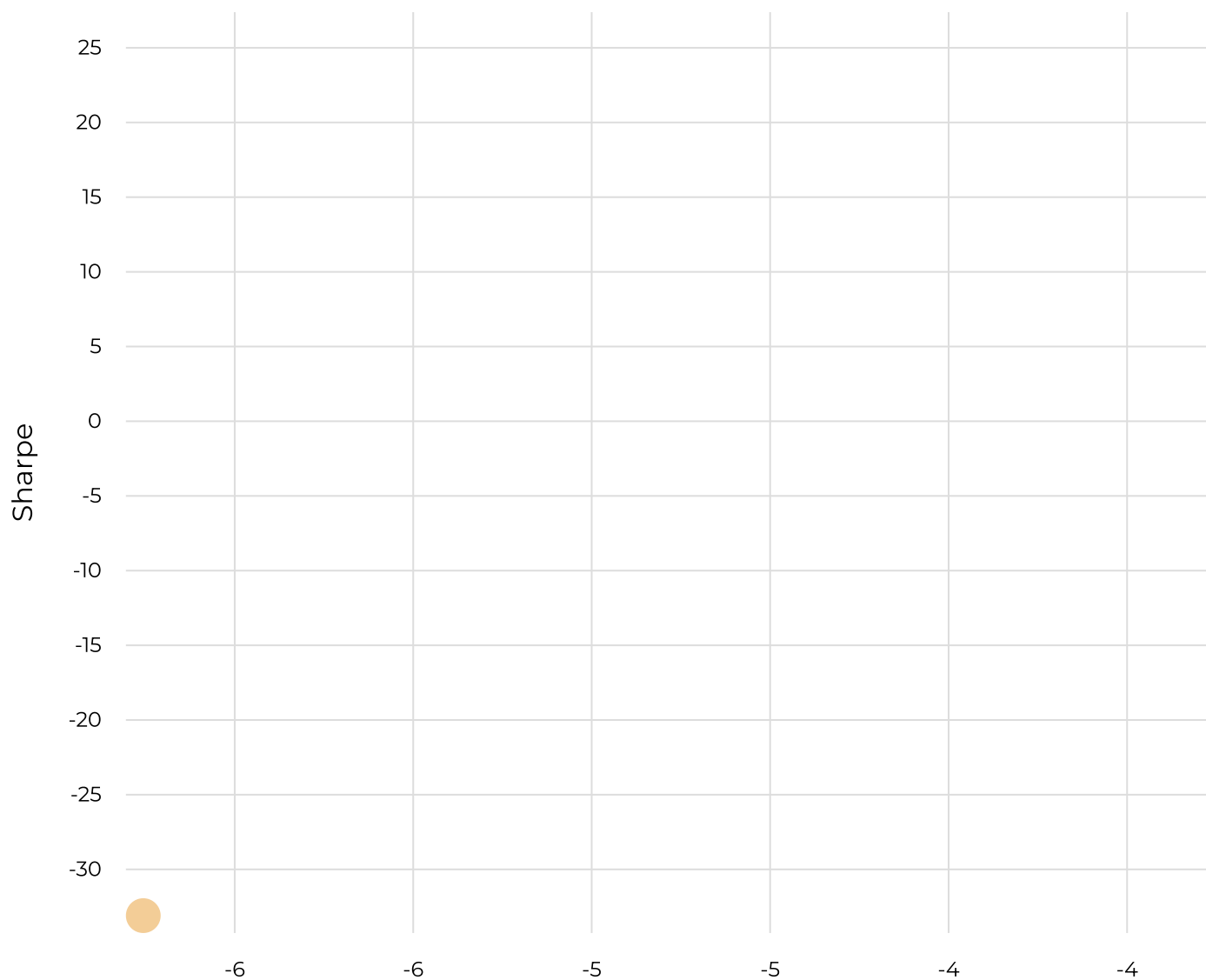


Rentabilidade x Sharpe

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	26,093857%	0,000062%	56,615445%	3,741254%



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	26,046047%	0,000099%	61,486294%	4,063129%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,219862%	0,000053%	52,845093%	3,492102%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL	CDI	26,151990%	0,000119%	61,344970%	4,053790%

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	20,995097%	0,005652%	49,799562%	3,290848%

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	25,907682%	0,000133%	60,701096%	4,011241%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,806074%	0,000138%	61,354469%	4,054417%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,384287%	0,004220%	56,303596%	3,720646%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-33,095369%	1,757686%	286,063642%	18,903618%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	6,849802%	0,000746%	5,510266%	0,364129%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	12,550300%	0,066410%	49,481281%	3,269815%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	-26,531713%	0,033478%	89,354069%	5,904683%

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	26,093857%	0,000062%	56,615445%	3,741254%

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	26,046047%	0,000099%	61,486294%	4,063129%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	26,151990%	0,000119%	61,344970%	4,053790%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-33,095369%	1,757686%	286,063642%	18,903618%

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	20,995097%	0,005652%	49,799562%	3,290848%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,907682%	0,000133%	60,701096%	4,011241%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,384287%	0,004220%	56,303596%	3,720646%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL	CDI	26,219862%	0,000053%	52,845093%	3,492102%

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	25,806074%	0,000138%	61,354469%	4,054417%

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	6,849802%	0,000746%	5,510266%	0,364129%

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	12,550300%	0,066410%	49,481281%	3,269815%
NTN-C 20310101	NTN-C	-26,531713%	0,033478%	89,354069%	5,904683%