

Índices da carteira

Mês/Ano

01/2022

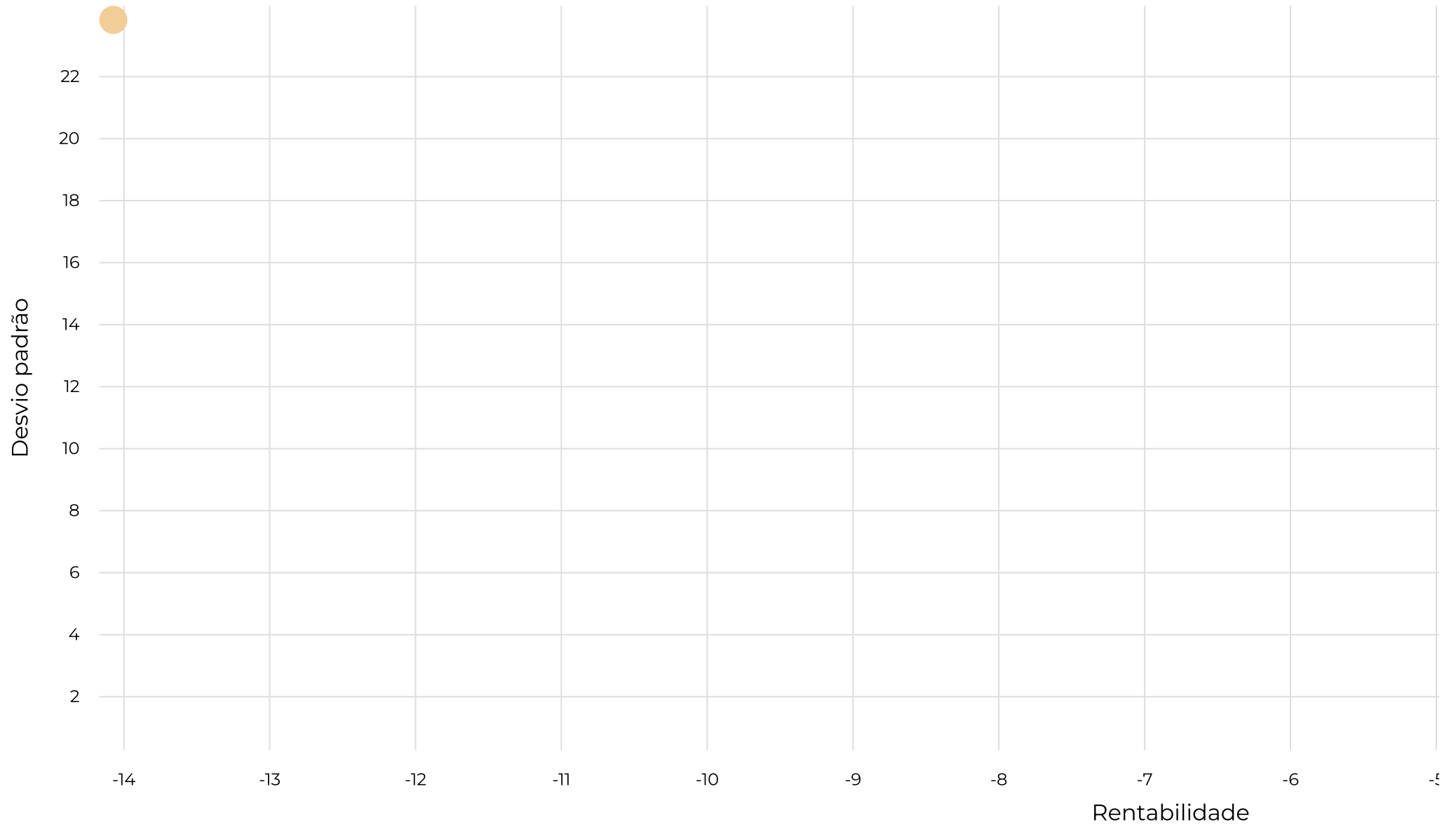


Imprimir

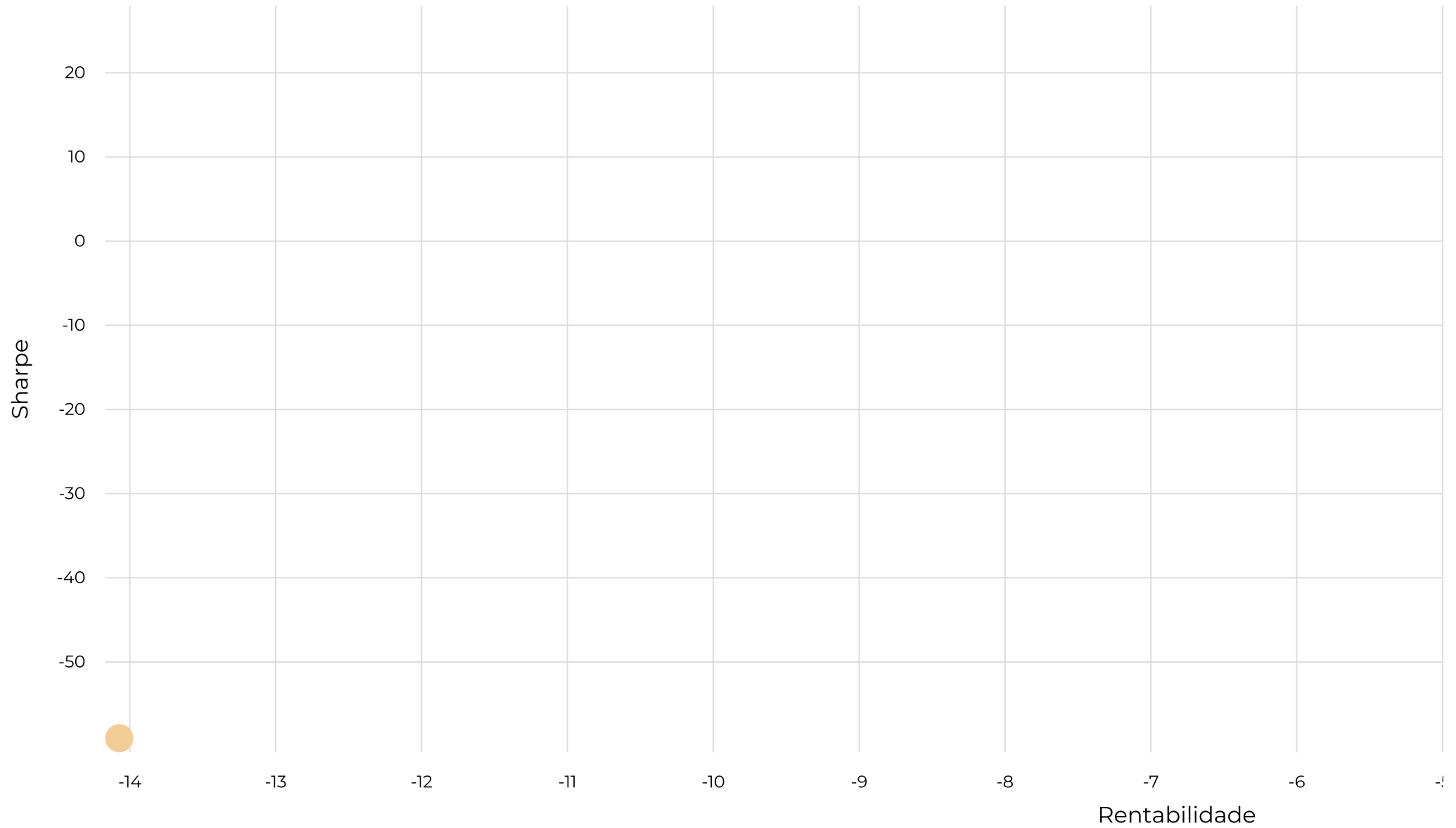
Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,292438%	0,000392%	18,989983%	1,249449%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,977653%	0,007537%	25,251903%	1,661453%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,279987%	0,001250%	15,383385%	1,012152%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,457837%	0,000450%	25,604937%	1,684681%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,165127%	0,006582%	25,240632%	1,660712%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,544043%	0,000303%	18,674063%	1,228663%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,384252%	0,001279%	15,607685%	1,026910%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	24,717939%	0,000500%	26,265083%	1,728116%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-59,055684%	4,987221%	362,172883%	23,829226%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-3,990166%	0,007021%	11,121046%	0,731711%
NTN-B20450515	NTN-B	-27,330625%	0,024360%	59,090522%	3,887871%
NTN-C 20310101	NTN-C	8,429202%	0,082504%	46,592815%	3,065582%

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 FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,292438%	0,000392%	18,989983%	1,249449%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,457837%	0,000450%	25,604937%	1,684681%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,544043%	0,000303%	18,674063%	1,228663%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	24,717939%	0,000500%	26,265083%	1,728116%

IDKA 2

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,977653%	0,007537%	25,251903%	1,661453%

IRF-M 1

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,279987%	0,001250%	15,383385%	1,012152%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,384252%	0,001279%	15,607685%	1,026910%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,165127%	0,006582%	25,240632%	1,660712%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-59,055684%	4,987221%	362,172883%	23,829226%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-3,990166%	0,007021%	11,121046%	0,731711%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	-27,330625%	0,024360%	59,090522%	3,887871%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	8,429202%	0,082504%	46,592815%	3,065582%

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 FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,292438%	0,000392%	18,989983%	1,249449%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,457837%	0,000450%	25,604937%	1,684681%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,544043%	0,000303%	18,674063%	1,228663%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	24,717939%	0,000500%	26,265083%	1,728116%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-59,055684%	4,987221%	362,172883%	23,829226%

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	21,977653%	0,007537%	25,251903%	1,661453%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,279987%	0,001250%	15,383385%	1,012152%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,165127%	0,006582%	25,240632%	1,660712%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,384252%	0,001279%	15,607685%	1,026910%

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	-3,990166%	0,007021%	11,121046%	0,731711%

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	-27,330625%	0,024360%	59,090522%	3,887871%
NTN-C 20310101	NTN-C	8,429202%	0,082504%	46,592815%	3,065582%

