

Índices da carteira

Mês/Ano

03/2022

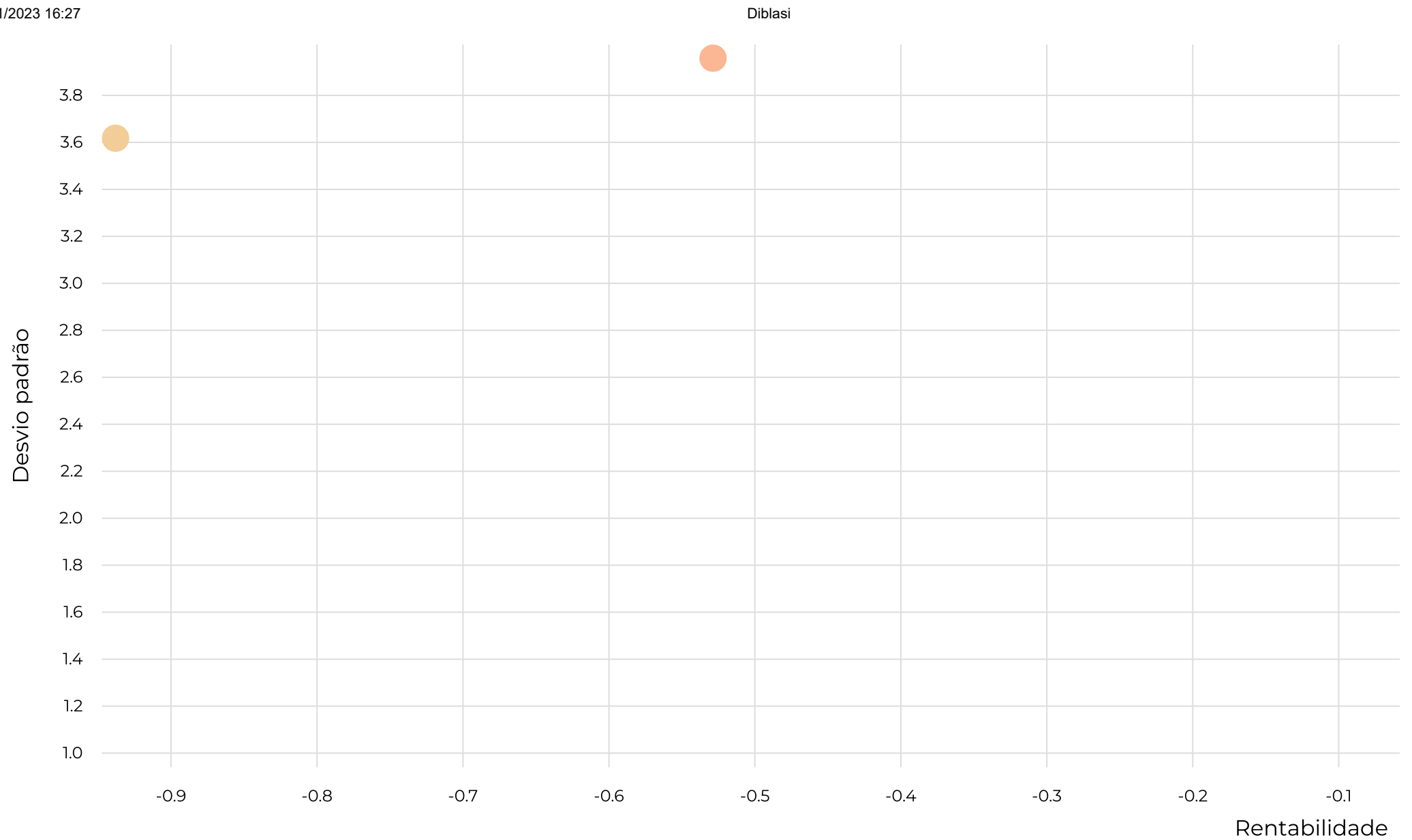


Imprimir

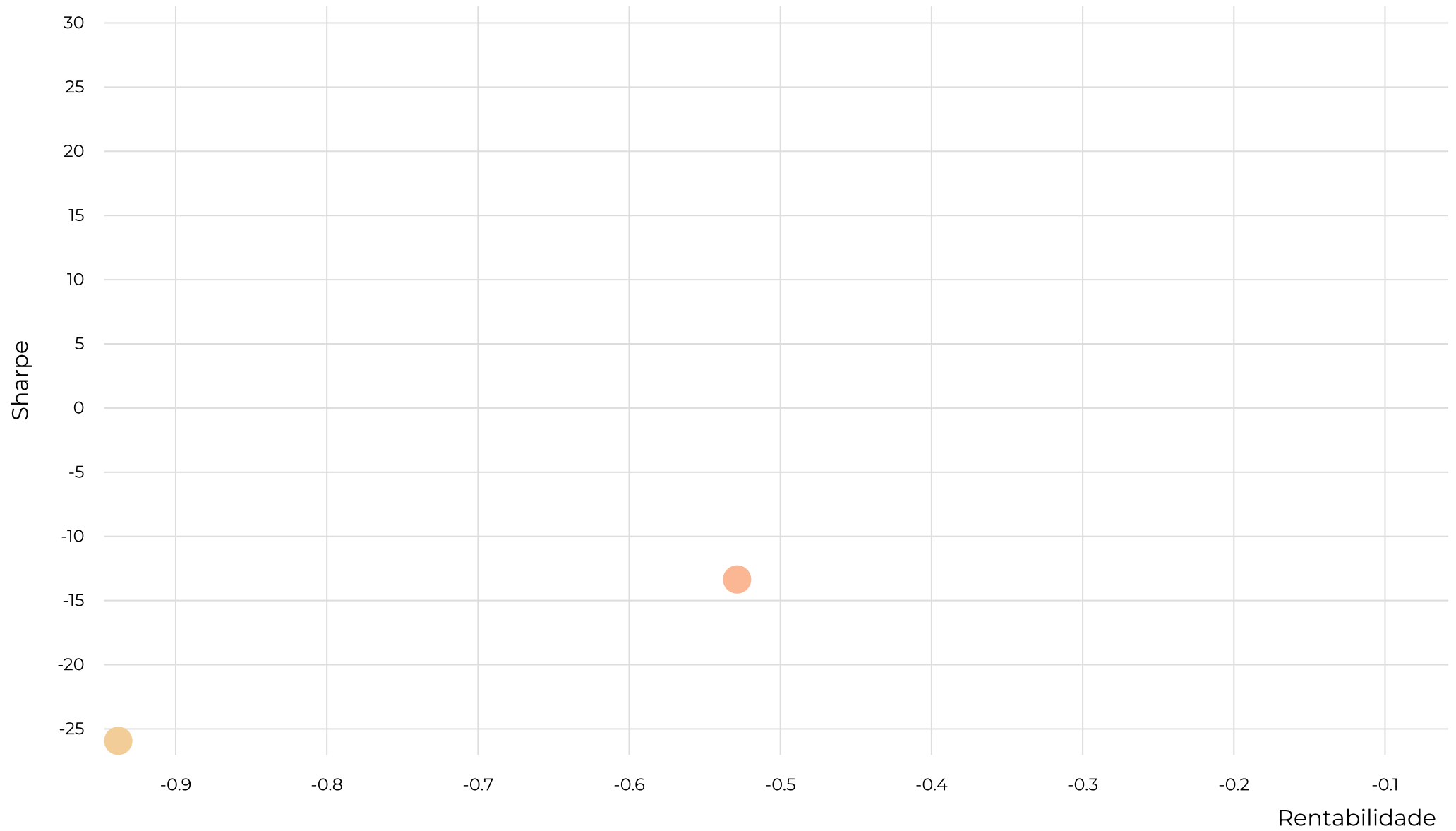
Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,210719%	0,000498%	25,816312%	1,702277%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	29,323649%	0,010491%	35,855518%	2,364243%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,390654%	0,001451%	22,862199%	1,507489%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,366400%	0,000538%	32,744938%	2,159137%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	30,225157%	0,009029%	35,152093%	2,317860%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,519054%	0,000391%	24,709847%	1,629319%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,580603%	0,001464%	22,886573%	1,509096%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,359238%	0,000474%	33,369796%	2,200339%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,929099%	0,004938%	54,863569%	3,617597%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	27,246588%	0,000649%	15,129374%	0,997601%
NTN-B20450515	NTN-B	-13,355434%	0,038203%	60,032526%	3,958428%
NTN-C 20310101	NTN-C	15,067207%	0,069632%	45,584534%	3,005755%

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	25,210719%	0,000498%	25,816312%	1,702277%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,366400%	0,000538%	32,744938%	2,159137%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,519054%	0,000391%	24,709847%	1,629319%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,359238%	0,000474%	33,369796%	2,200339%

IDKA 2

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	29,323649%	0,010491%	35,855518%	2,364243%

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	26,390654%	0,001451%	22,862199%	1,507489%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,580603%	0,001464%	22,886573%	1,509096%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	30,225157%	0,009029%	35,152093%	2,317860%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,929099%	0,004938%	54,863569%	3,617597%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	27,246588%	0,000649%	15,129374%	0,997601%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	-13,355434%	0,038203%	60,032526%	3,958428%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	15,067207%	0,069632%	45,584534%	3,005755%

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	25,210719%	0,000498%	25,816312%	1,702277%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,366400%	0,000538%	32,744938%	2,159137%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,519054%	0,000391%	24,709847%	1,629319%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,359238%	0,000474%	33,369796%	2,200339%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,929099%	0,004938%	54,863569%	3,617597%

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	29,323649%	0,010491%	35,855518%	2,364243%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,390654%	0,001451%	22,862199%	1,507489%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	30,225157%	0,009029%	35,152093%	2,317860%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,580603%	0,001464%	22,886573%	1,509096%

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	27,246588%	0,000649%	15,129374%	0,997601%

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	-13,355434%	0,038203%	60,032526%	3,958428%
NTN-C 20310101	NTN-C	15,067207%	0,069632%	45,584534%	3,005755%

