

Índices da carteira

Mês/Ano

08/2022

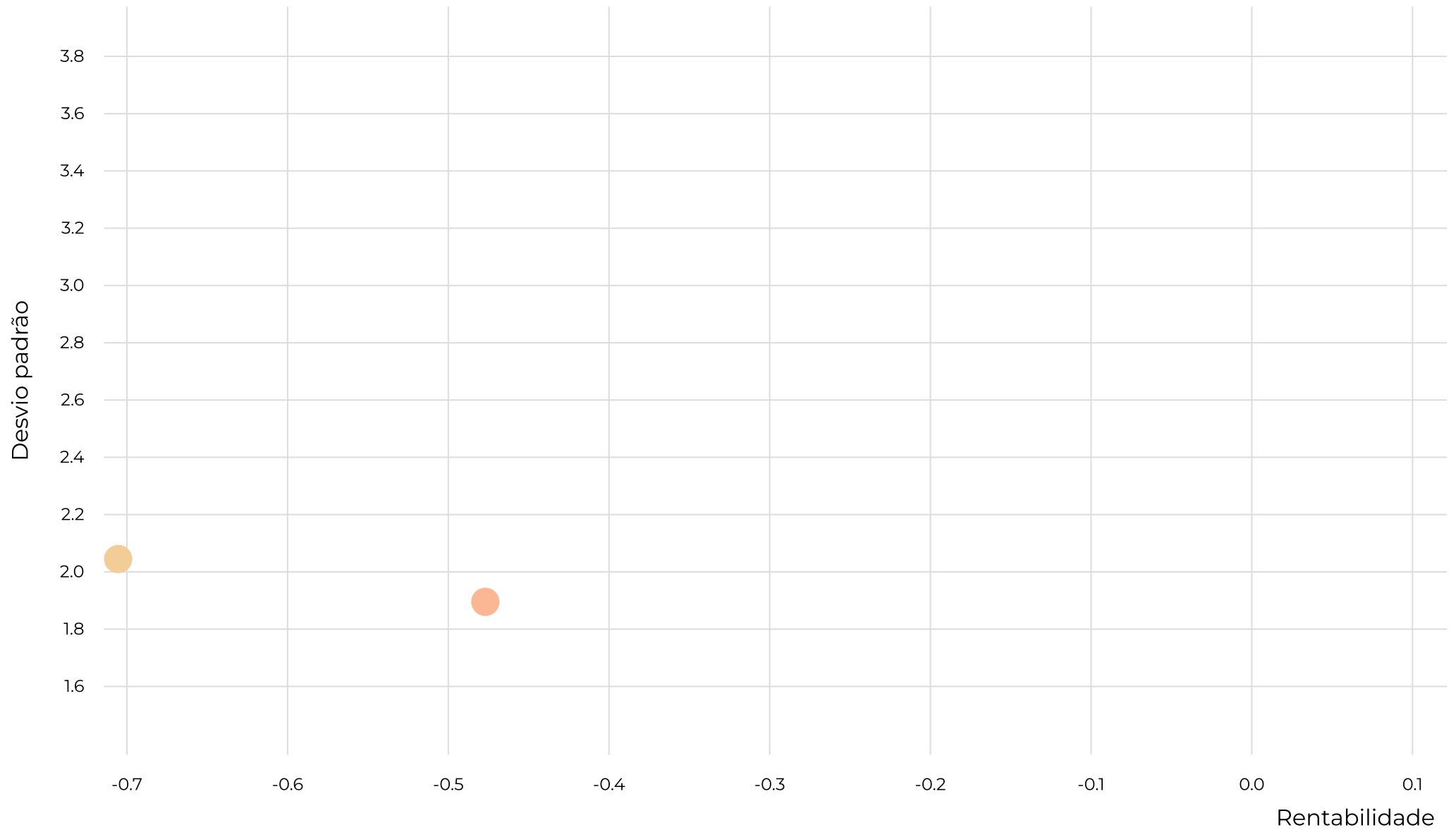


Imprimir

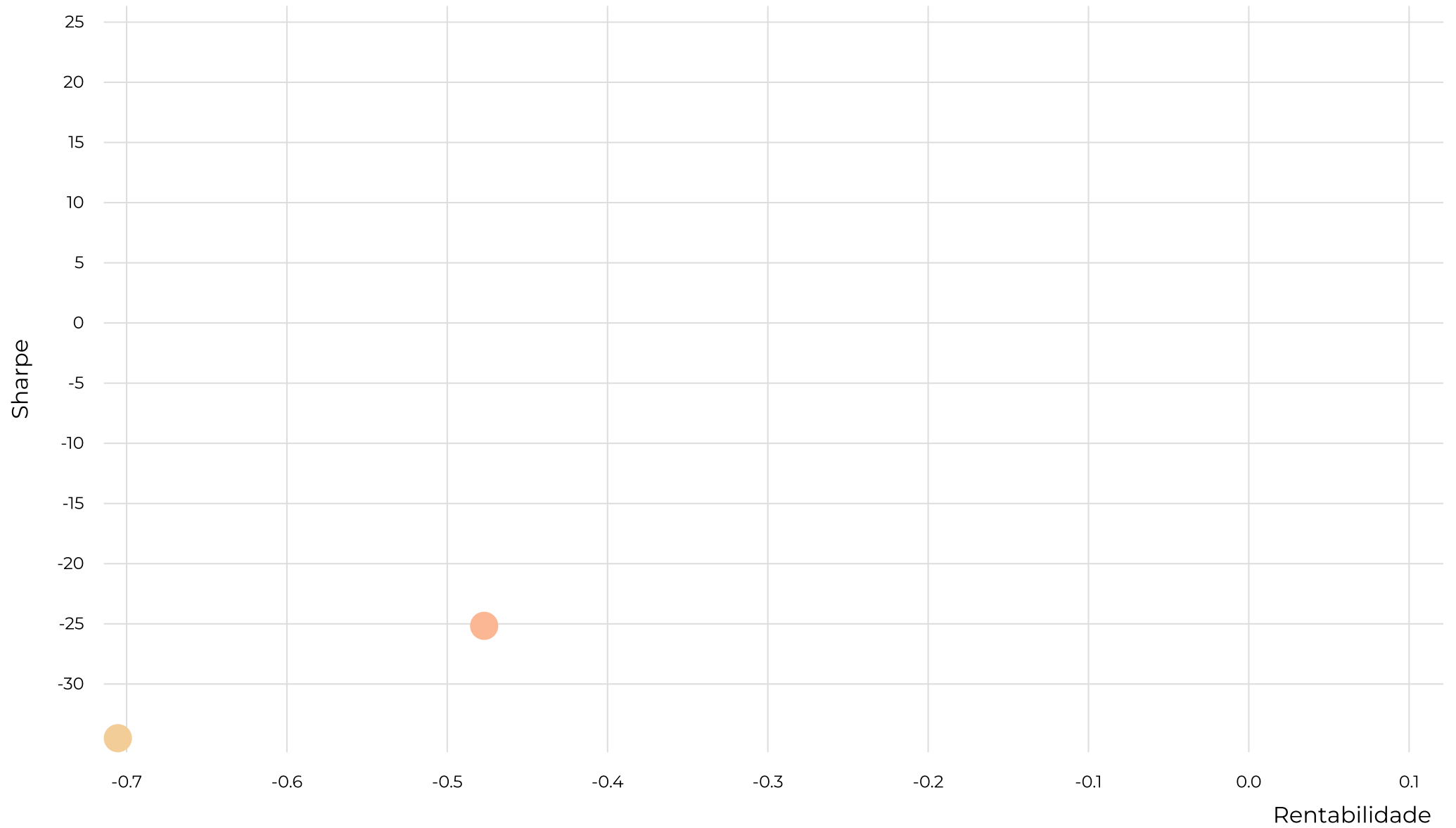
Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,119726%	0,000493%	43,890092%	2,894027%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	20,156417%	0,011226%	55,773790%	3,677615%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	23,997975%	0,001773%	44,544495%	2,937177%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,146360%	0,000483%	50,326575%	3,318436%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	20,178861%	0,010539%	59,518501%	3,924534%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,183278%	0,000435%	41,369402%	2,727818%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	23,997101%	0,001802%	44,575116%	2,939196%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,297303%	0,000442%	50,316564%	3,317776%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-34,500113%	0,007710%	31,010627%	2,044780%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	23,196564%	0,000678%	21,392372%	1,410571%
NTN-B20450515	NTN-B	-25,164363%	0,046196%	28,744573%	1,895361%
NTN-C 20310101	NTN-C	10,338551%	0,029302%	51,723809%	3,410567%

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	25,119726%	0,000493%	43,890092%	2,894027%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,146360%	0,000483%	50,326575%	3,318436%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,183278%	0,000435%	41,369402%	2,727818%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,297303%	0,000442%	50,316564%	3,317776%

IDKA 2

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	20,156417%	0,011226%	55,773790%	3,677615%

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	23,997975%	0,001773%	44,544495%	2,937177%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	23,997101%	0,001802%	44,575116%	2,939196%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	20,178861%	0,010539%	59,518501%	3,924534%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-34,500113%	0,007710%	31,010627%	2,044780%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	23,196564%	0,000678%	21,392372%	1,410571%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	-25,164363%	0,046196%	28,744573%	1,895361%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	10,338551%	0,029302%	51,723809%	3,410567%

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	25,119726%	0,000493%	43,890092%	2,894027%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,146360%	0,000483%	50,326575%	3,318436%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,183278%	0,000435%	41,369402%	2,727818%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,297303%	0,000442%	50,316564%	3,317776%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-34,500113%	0,007710%	31,010627%	2,044780%

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	20,156417%	0,011226%	55,773790%	3,677615%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	23,997975%	0,001773%	44,544495%	2,937177%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	20,178861%	0,010539%	59,518501%	3,924534%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	23,997101%	0,001802%	44,575116%	2,939196%

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	23,196564%	0,000678%	21,392372%	1,410571%

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	-25,164363%	0,046196%	28,744573%	1,895361%
NTN-C 20310101	NTN-C	10,338551%	0,029302%	51,723809%	3,410567%

