

Índices da carteira

Mês/Ano

09/2022

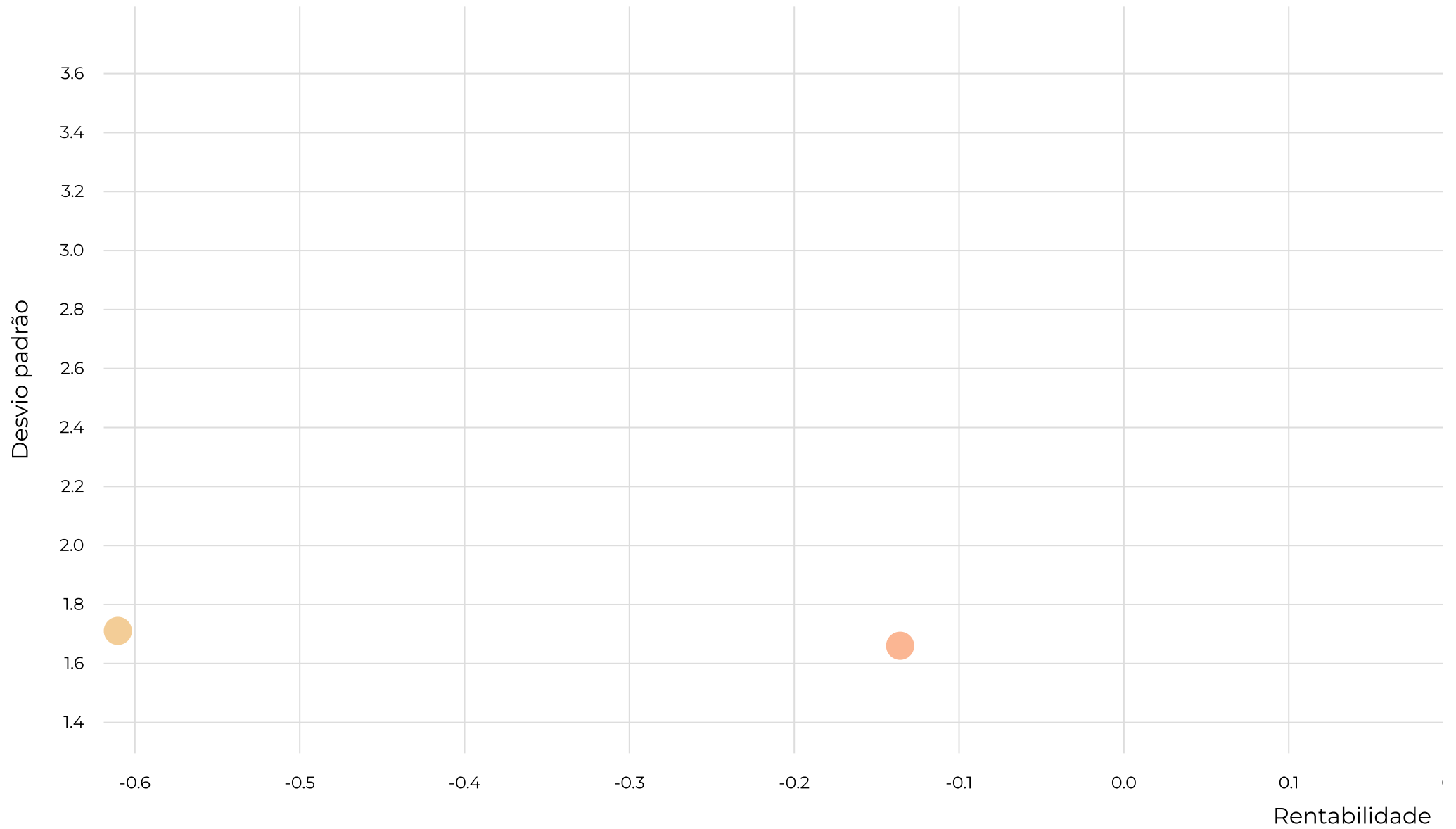


Imprimir

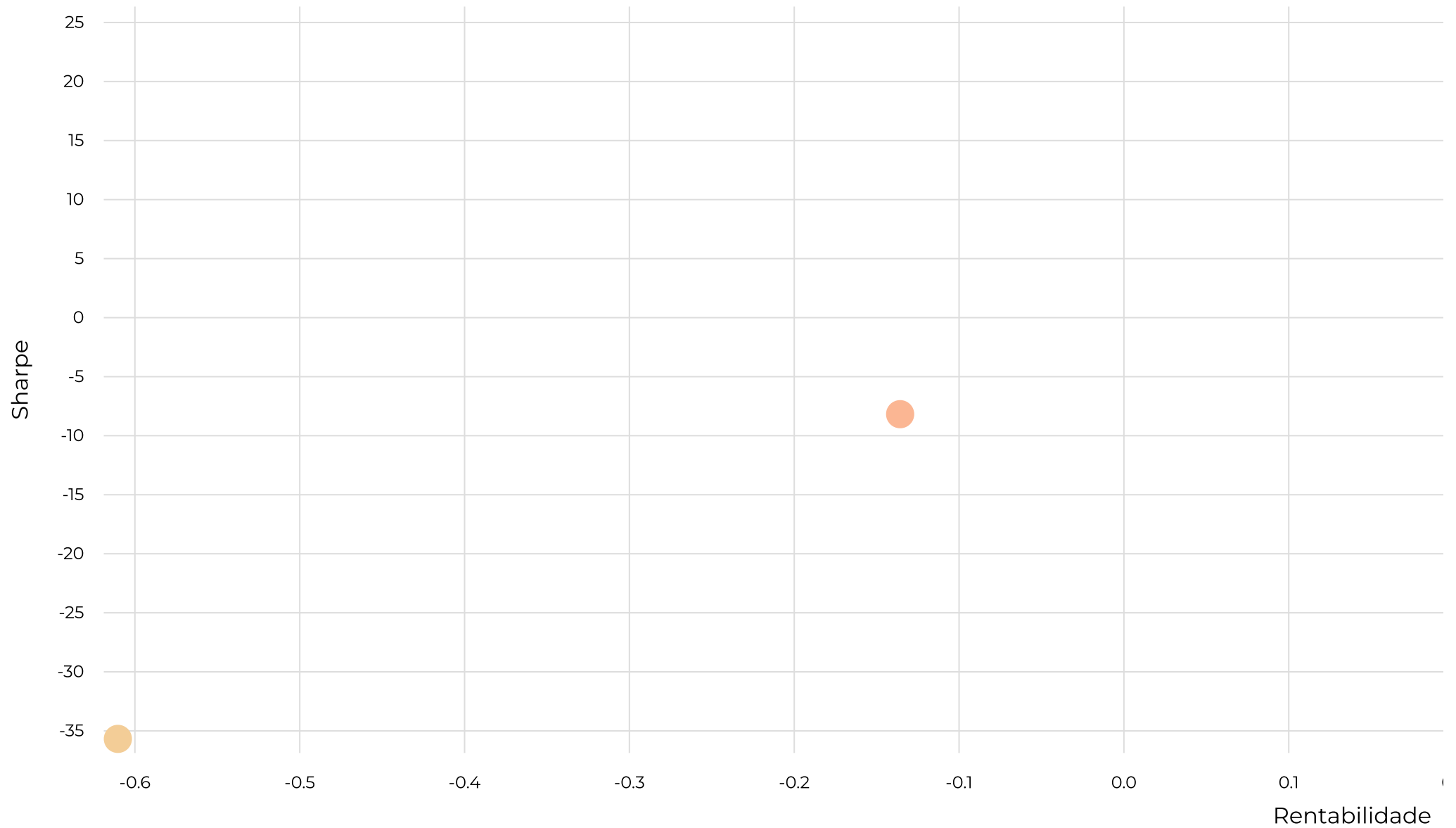
| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR | VOL | D. Padrão |
|--|-----------|-------------|-----------|------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI | 25,118727% | 0,000403% | 47,350671% | 3,108724% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | IDKA 2 | 19,678559% | 0,011179% | 54,127524% | 3,553646% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | IRF-M 1 | 23,551062% | 0,001761% | 49,464773% | 3,247521% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | CDI | 25,155412% | 0,000393% | 53,726171% | 3,527296% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA | 18,635268% | 0,010793% | 57,566619% | 3,779434% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA | CDI | 25,155476% | 0,000357% | 44,624178% | 2,929721% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IRF-M 1 | 23,516475% | 0,001799% | 49,513736% | 3,250736% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CDI | 25,141118% | 0,000398% | 53,755297% | 3,529208% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | IMA-B | -35,681496% | 0,008090% | 26,054082% | 1,710534% |

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR | VOL | D. Padrão |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS | FIDC | 22,985295% | 0,000658% | 20,463380% | 1,343487% |
| NTN-B20450515 | NTN-B | -8,177693% | 0,053793% | 25,285498% | 1,660074% |
| NTN-C 20310101 | NTN-C | 13,383365% | 0,027510% | 49,170782% | 3,228220% |

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 | 25,118727% | 0,000403% | 47,350671% | 3,108724% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | CDI | 25,155412% | 0,000393% | 53,726171% | 3,527296% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA | CDI | 25,155476% | 0,000357% | 44,624178% | 2,929721% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CDI | 25,141118% | 0,000398% | 53,755297% | 3,529208% |

IDKA 2

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|--|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | IDKA 2 | 19,678559% | 0,011179% | 54,127524% | 3,553646% |

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 | 23,551062% | 0,001761% | 49,464773% | 3,247521% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IRF-M 1 | 23,516475% | 0,001799% | 49,513736% | 3,250736% |

IPCA

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|--|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA | 18,635268% | 0,010793% | 57,566619% | 3,779434% |

IMA-B

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|---|-----------|-------------|-----------|------------|-----------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | IMA-B | -35,681496% | 0,008090% | 26,054082% | 1,710534% |

FIDC

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS | FIDC | 22,985295% | 0,000658% | 20,463380% | 1,343487% |

NTN-B

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|---------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| NTN-B20450515 | NTN-B | -8,177693% | 0,053793% | 25,285498% | 1,660074% |

NTN-C

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|----------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| NTN-C 20310101 | NTN-C | 13,383365% | 0,027510% | 49,170782% | 3,228220% |

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 | 25,118727% | 0,000403% | 47,350671% | 3,108724% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | CDI | 25,155412% | 0,000393% | 53,726171% | 3,527296% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA | CDI | 25,155476% | 0,000357% | 44,624178% | 2,929721% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CDI | 25,141118% | 0,000398% | 53,755297% | 3,529208% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | IMA-B | -35,681496% | 0,008090% | 26,054082% | 1,710534% |

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 | 19,678559% | 0,011179% | 54,127524% | 3,553646% |

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 12M | D. Padrão |
|--|-----------|------------|-----------|------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | IRF-M 1 | 23,551062% | 0,001761% | 49,464773% | 3,247521% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA | 18,635268% | 0,010793% | 57,566619% | 3,779434% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IRF-M 1 | 23,516475% | 0,001799% | 49,513736% | 3,250736% |

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 | 22,985295% | 0,000658% | 20,463380% | 1,343487% |

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 | -8,177693% | 0,053793% | 25,285498% | 1,660074% |
| NTN-C 20310101 | NTN-C | 13,383365% | 0,027510% | 49,170782% | 3,228220% |

