

# Índices da carteira

Mês/Ano

01/2023

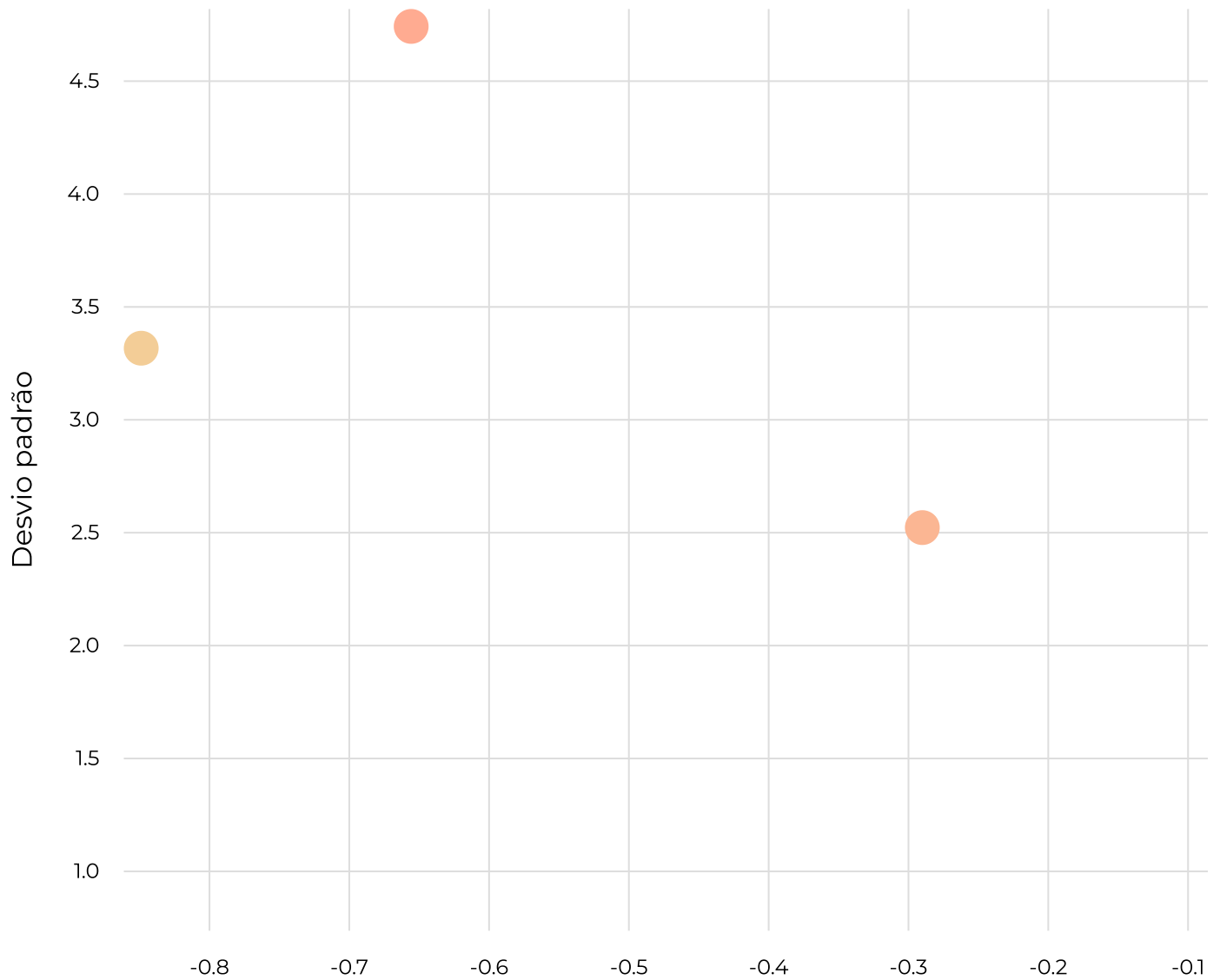


Imprimir

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,372682%	0,000136%	55,288132%	3,645591%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	33,878863%	0,008142%	38,695692%	2,551518%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,240137%	0,000218%	58,016149%	3,825472%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,373974%	0,000137%	61,038678%	4,024771%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	32,290907%	0,007663%	48,012171%	3,165829%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,439403%	0,000110%	51,916763%	3,423290%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-	IRF-M 1	25,295537%	0,000227%	58,272729%	3,842390%

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	25,340928%	0,000133%	61,325529%	4,043686%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,590094%	0,013508%	50,305790%	3,317066%
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	33,544412%	0,000559%	12,345954%	0,814068%
NTN-B20450515	NTN-B	-11,499624%	0,050811%	38,257141%	2,522601%
NTN-C 20310101	NTN-C	-13,826910%	0,047085%	71,922074%	4,742401%

## Rentabilidade x Desvio padrão

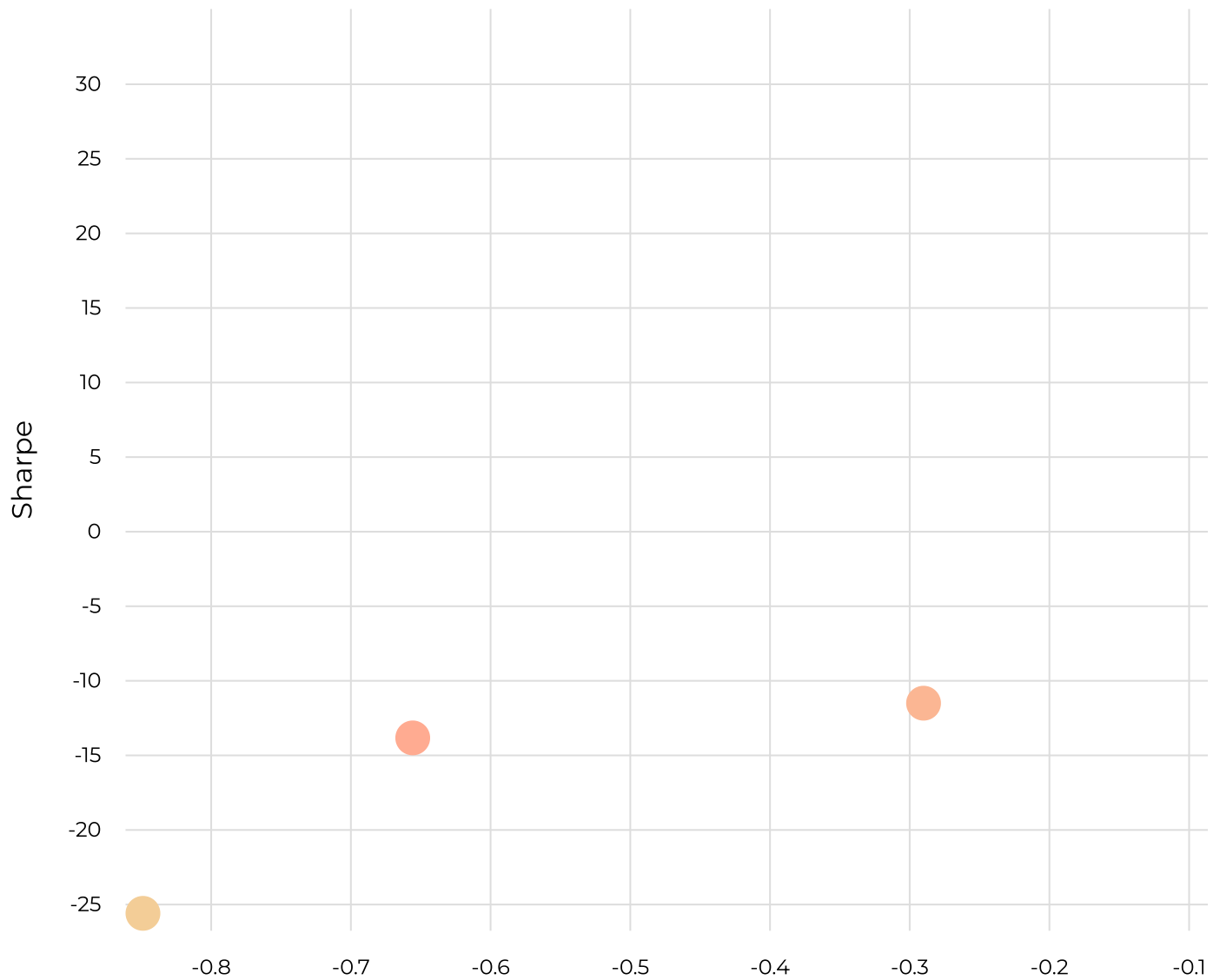


## Rentabilidade x Sharpe

### 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	25,372682%	0,000136%	55,288132%	3,645591%



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	25,373974%	0,000137%	61,038678%	4,024771%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,439403%	0,000110%	51,916763%	3,423290%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL	CDI	25,340928%	0,000133%	61,325529%	4,043686%

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	33,878863%	0,008142%	38,695692%	2,551518%

**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	25,240137%	0,000218%	58,016149%	3,825472%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,295537%	0,000227%	58,272729%	3,842390%

**IPCA**

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	32,290907%	0,007663%	48,012171%	3,165829%

**IMA-B**

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,590094%	0,013508%	50,305790%	3,317066%

## FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	33,544412%	0,000559%	12,345954%	0,814068%

## NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	-11,499624%	0,050811%	38,257141%	2,522601%

## NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	-13,826910%	0,047085%	71,922074%	4,742401%

## 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	25,372682%	0,000136%	55,288132%	3,645591%

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	25,373974%	0,000137%	61,038678%	4,024771%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	25,439403%	0,000110%	51,916763%	3,423290%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,340928%	0,000133%	61,325529%	4,043686%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,590094%	0,013508%	50,305790%	3,317066%

#### 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	33,878863%	0,008142%	38,695692%	2,551518%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,240137%	0,000218%	58,016149%	3,825472%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS	IPCA	32,290907%	0,007663%	48,012171%	3,165829%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO					
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,295537%	0,000227%	58,272729%	3,842390%

#### Res. 4.963/2021 - FIDC Sênior - Art. 7º, V, "a"

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	33,544412%	0,000559%	12,345954%	0,814068%

#### 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	-11,499624%	0,050811%	38,257141%	2,522601%
NTN-C 20310101	NTN-C	-13,826910%	0,047085%	71,922074%	4,742401%