

# Índices da carteira

Mês/Ano

04/2023

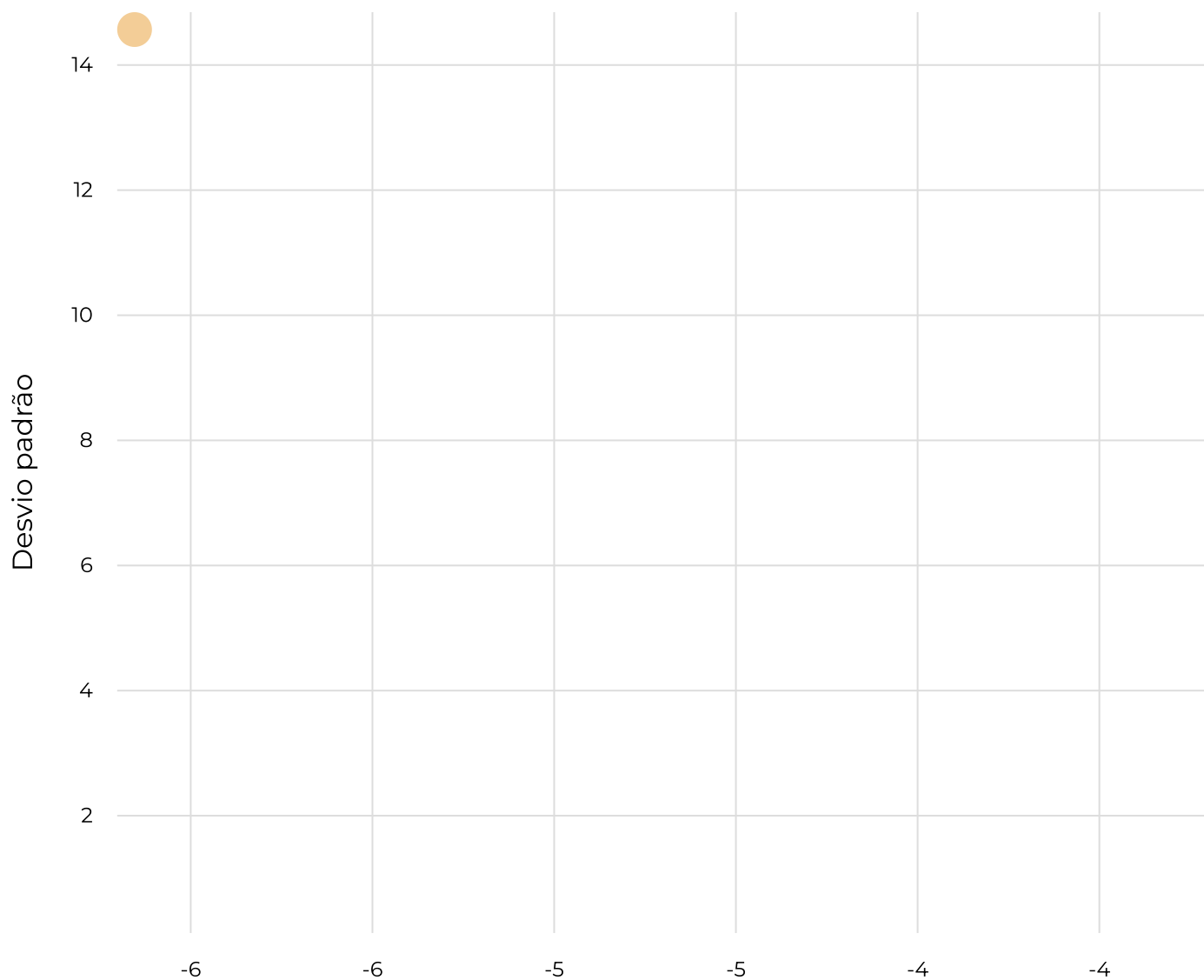


Imprimir

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,872338%	0,000058%	57,144099%	3,743634%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	23,804197%	0,005569%	46,371160%	3,037876%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,526611%	0,000136%	61,146460%	4,005838%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,788699%	0,000092%	62,222067%	4,076303%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,940390%	0,004173%	51,646200%	3,383455%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	25,983481%	0,000050%	53,388294%	3,497583%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-	IRF-M 1	25,477794%	0,000142%	61,709870%	4,042748%

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	25,854522%	0,000106%	62,081272%	4,067079%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-42,249404%	1,769146%	222,357761%	14,567141%
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	17,183795%	0,000678%	6,146785%	0,402689%
NTN-B20450515	NTN-B	5,603209%	0,067920%	41,560575%	2,722724%
NTN-C 20310101	NTN-C	-19,507560%	0,029177%	86,966851%	5,697388%

## Rentabilidade x Desvio padrão

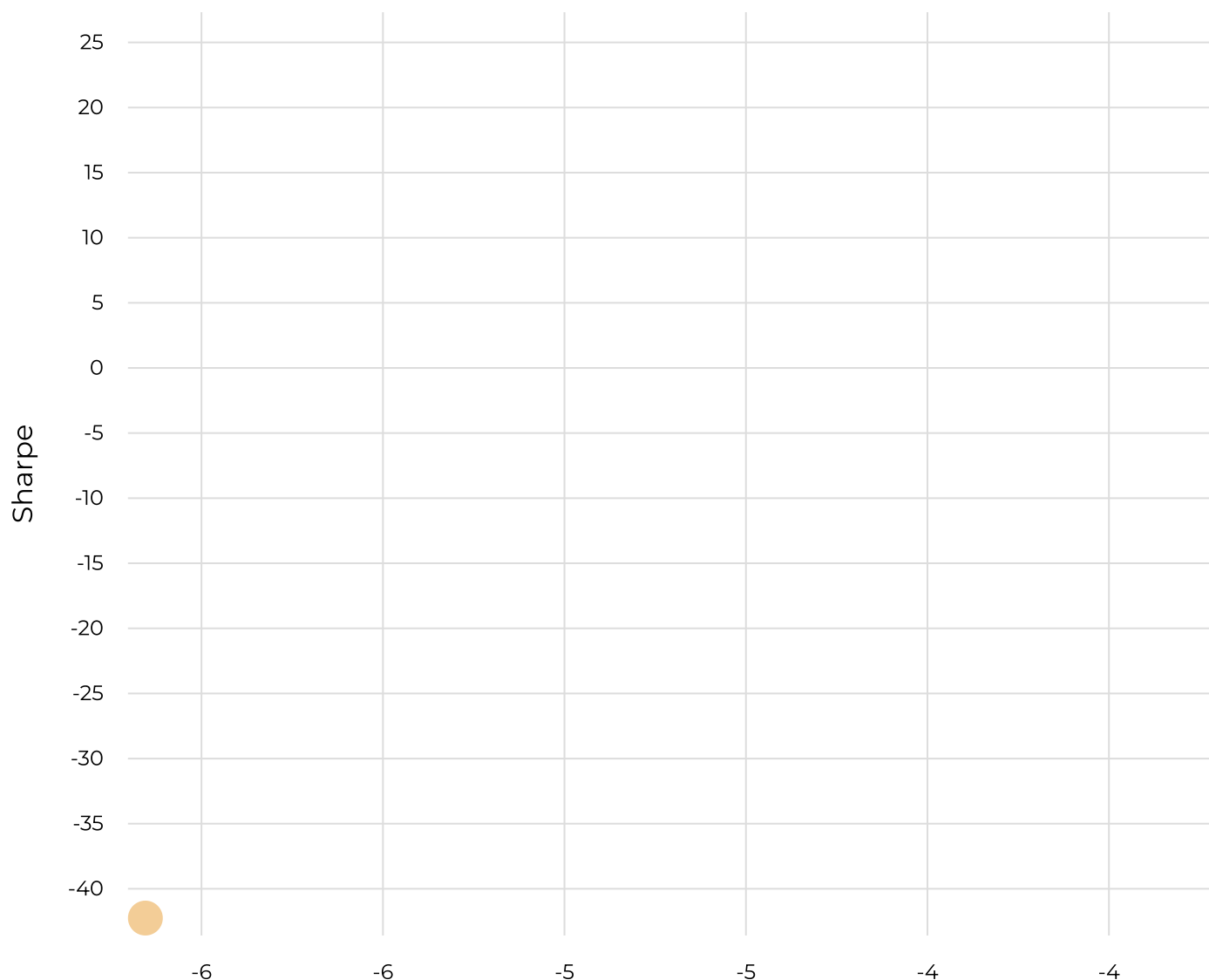


## Rentabilidade x Sharpe

### 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	25,872338%	0,000058%	57,144099%	3,743634%



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	25,788699%	0,000092%	62,222067%	4,076303%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	25,983481%	0,000050%	53,388294%	3,497583%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL	CDI	25,854522%	0,000106%	62,081272%	4,067079%

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	23,804197%	0,005569%	46,371160%	3,037876%

**IRF-M 1**

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,526611%	0,000136%	61,146460%	4,005838%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,477794%	0,000142%	61,709870%	4,042748%

**IPCA**

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,940390%	0,004173%	51,646200%	3,383455%

**IMA-B**

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-42,249404%	1,769146%	222,357761%	14,567141%

## FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	17,183795%	0,000678%	6,146785%	0,402689%

## NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	5,603209%	0,067920%	41,560575%	2,722724%

## NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	-19,507560%	0,029177%	86,966851%	5,697388%

## 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	25,872338%	0,000058%	57,144099%	3,743634%

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	25,788699%	0,000092%	62,222067%	4,076303%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	25,854522%	0,000106%	62,081272%	4,067079%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-42,249404%	1,769146%	222,357761%	14,567141%

#### 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	23,804197%	0,005569%	46,371160%	3,037876%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,526611%	0,000136%	61,146460%	4,005838%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	22,940390%	0,004173%	51,646200%	3,383455%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL	CDI	25,983481%	0,000050%	53,388294%	3,497583%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES					
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,477794%	0,000142%	61,709870%	4,042748%

#### 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	17,183795%	0,000678%	6,146785%	0,402689%

#### 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	5,603209%	0,067920%	41,560575%	2,722724%
NTN-C 20310101	NTN-C	-19,507560%	0,029177%	86,966851%	5,697388%