

Índices da carteira

Mês/Ano

07/2023

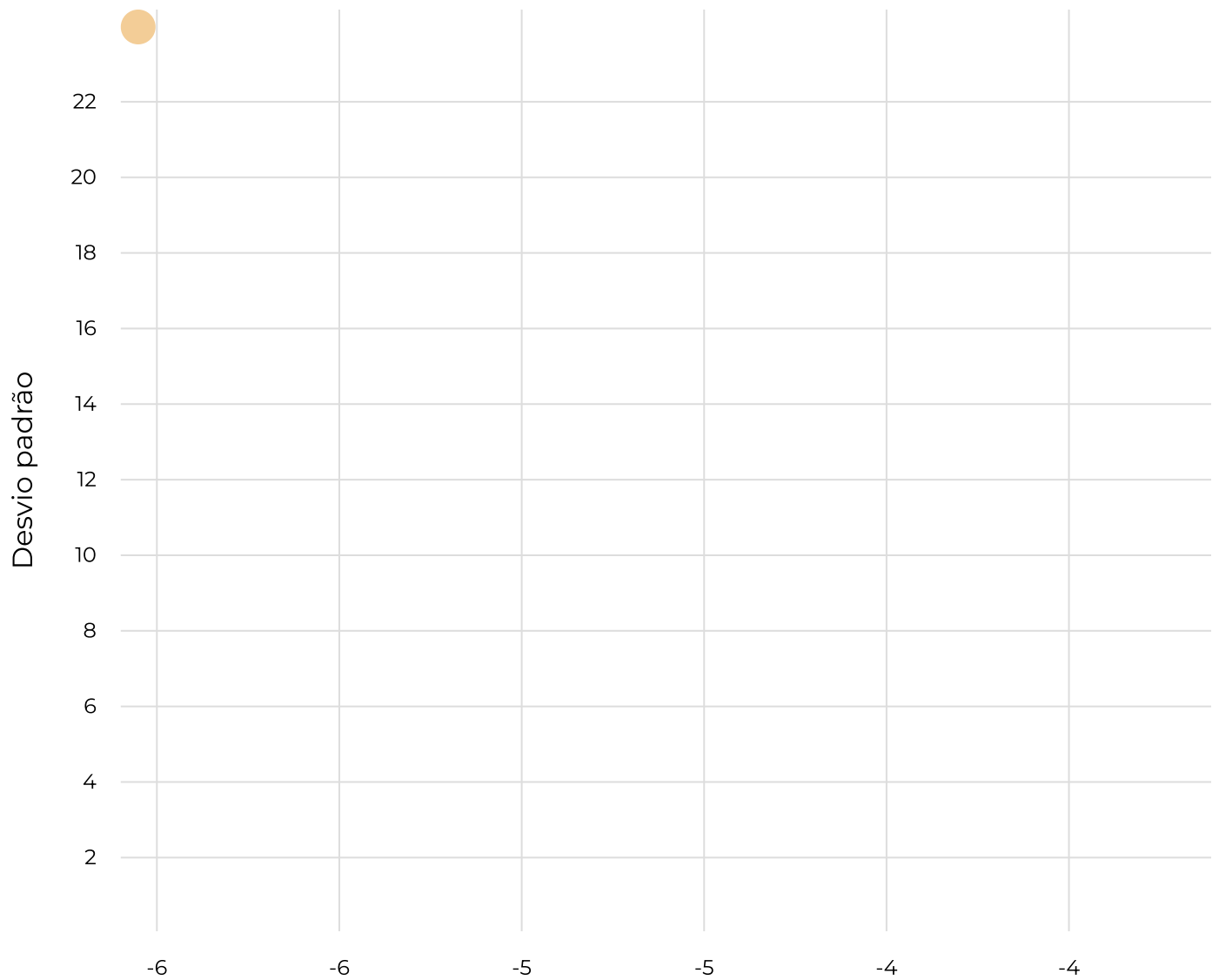


Imprimir

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	26,422684%	0,000059%	56,500068%	3,725504%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	22,904976%	0,004687%	56,358814%	3,716190%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,423943%	0,000128%	60,873549%	4,013883%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	26,411785%	0,000098%	61,221411%	4,036820%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	23,072086%	0,003407%	64,128642%	4,228517%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,644436%	0,000057%	53,041479%	3,497452%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-	IRF-M 1	26,353077%	0,000128%	61,591816%	4,061244%

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	26,550831%	0,000122%	61,454687%	4,052202%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,235852%	1,776127%	363,658219%	23,978913%
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-14,789318%	0,000785%	7,759223%	0,511628%
NTN-B20450515	NTN-B	22,039845%	0,062115%	77,357740%	5,100818%
NTN-C 20310101	NTN-C	-27,227765%	0,027597%	86,906116%	5,730420%

Rentabilidade x Desvio padrão

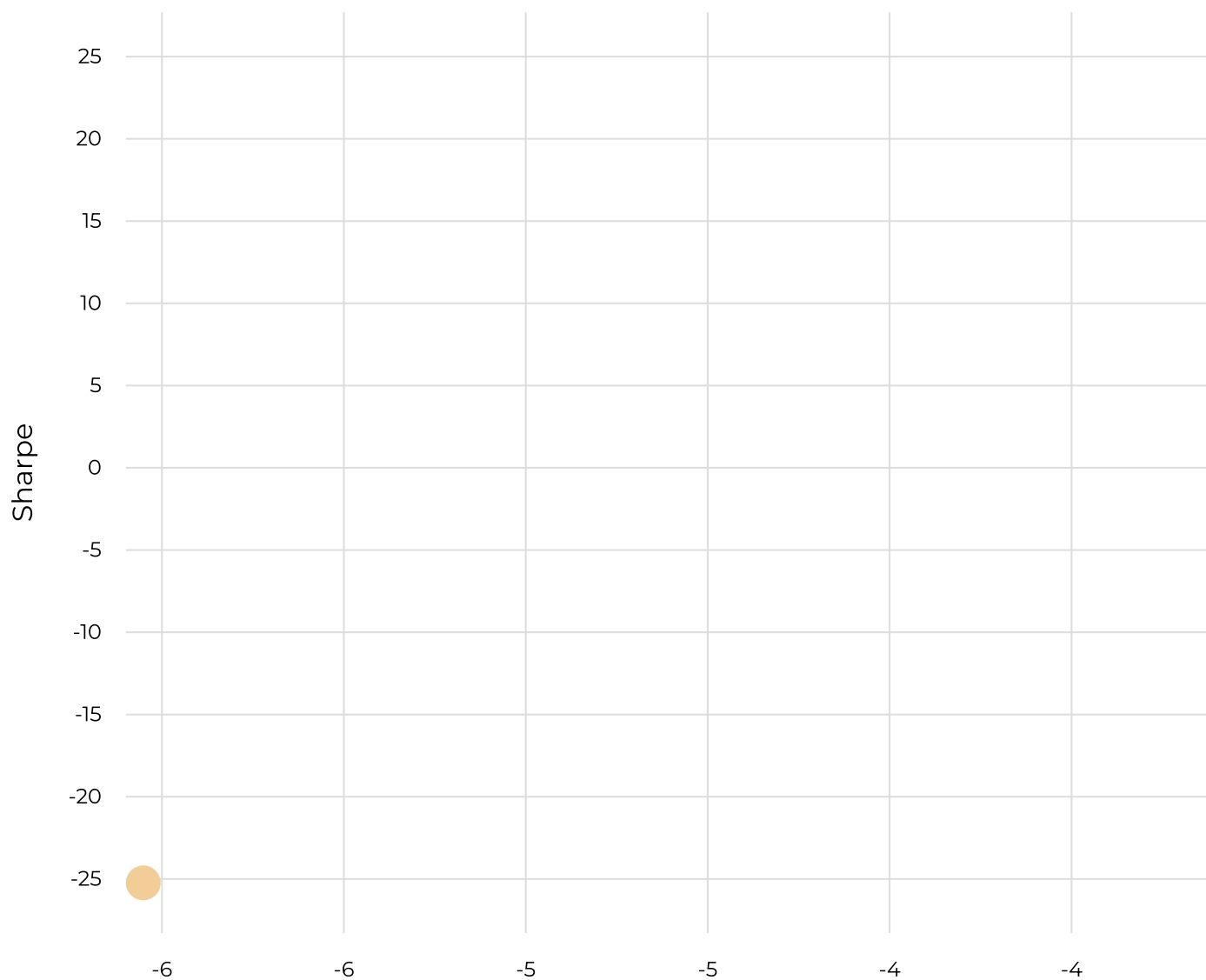


Rentabilidade x Sharpe

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	26,422684%	0,000059%	56,500068%	3,725504%



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	26,411785%	0,000098%	61,221411%	4,036820%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	26,644436%	0,000057%	53,041479%	3,497452%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL	CDI	26,550831%	0,000122%	61,454687%	4,052202%

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	22,904976%	0,004687%	56,358814%	3,716190%

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	26,423943%	0,000128%	60,873549%	4,013883%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,353077%	0,000128%	61,591816%	4,061244%

IPCA

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	23,072086%	0,003407%	64,128642%	4,228517%

IMA-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,235852%	1,776127%	363,658219%	23,978913%

FIDC

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	-14,789318%	0,000785%	7,759223%	0,511628%

NTN-B

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-B20450515	NTN-B	22,039845%	0,062115%	77,357740%	5,100818%

NTN-C

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 12M	D. Padrão
NTN-C 20310101	NTN-C	-27,227765%	0,027597%	86,906116%	5,730420%

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	26,422684%	0,000059%	56,500068%	3,725504%

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	26,411785%	0,000098%	61,221411%	4,036820%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	26,550831%	0,000122%	61,454687%	4,052202%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-25,235852%	1,776127%	363,658219%	23,978913%

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	22,904976%	0,004687%	56,358814%	3,716190%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,423943%	0,000128%	60,873549%	4,013883%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	23,072086%	0,003407%	64,128642%	4,228517%
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL	CDI	26,644436%	0,000057%	53,041479%	3,497452%

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	26,353077%	0,000128%	61,591816%	4,061244%

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	-14,789318%	0,000785%	7,759223%	0,511628%

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	22,039845%	0,062115%	77,357740%	5,100818%
NTN-C 20310101	NTN-C	-27,227765%	0,027597%	86,906116%	5,730420%