Mês/Ano

01/2022 Imprimir

Medidas de risco

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emitentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).
Indice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classicação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.
VaR - Value at Risk: Value-at-risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	IBX	-2,926673%	0,233187%	36,879272%	69,459368%	125,925993%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,292438%	0,000392%	5,393343%	11,285980%	18,989983%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IMA-GERAL	2,232953%	0,006992%	4,247297%	10,839552%	10,928057%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	21,977653%	0,007537%	3,380214%	16,210036%	25,251903%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IMA-B 5	21,767116%	0,007961%	3,807577%	16,645492%	24,250264%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	-10,893482%	0,020578%	3,137546%	14,282926%	16,611707%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B 5+	-25,003322%	0,042441%	7,883371%	20,009069%	35,094907%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,457837%	0,000450%	6,532610%	13,958686%	25,604937%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	-10,885129%	0,020489%	3,083168%	14,286612%	16,580749%

Nome	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	26,384252%	0,001279%	5,935358%	10,064745%	15,607685%
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS - FUNDO DE INVESTIMENTO	IBX-50	5,087334%	0,162996%	33,518496%	43,247062%	73,917632%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBX-50	-8,375475%	0,304453%	20,994185%	103,666150%	162,055820%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIM	CDI	24,157581%	0,002419%	5,754427%	16,568728%	25,306170%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		8,540394%	0,057969%			

Provisão de risco - Mercado

Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	10.418.335/0001-88	IBX	R$ 1.388.188,80	233,187177%	125,925993%	R$ 3.237,08
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R$ 1.849.772,74	0,391939%	18,989983%	R$ 7,25
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R$ 0,00	0,391939%	18,989983%	R$ 0,00
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25.078.994/0001-90	IMA-GERAL	R$ 0,00	6,991981%	10,928057%	R$ 0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	R$ 41.562,59	7,537292%	25,251903%	R$ 3,13
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	03.543.447/0001-03	IMA-B 5	R$ 832.688,47	7,960507%	24,250264%	R$ 66,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.442.078/0001-05	IMA-B	R$ 961.821,04	20,577887%	16,611707%	R$ 197,92

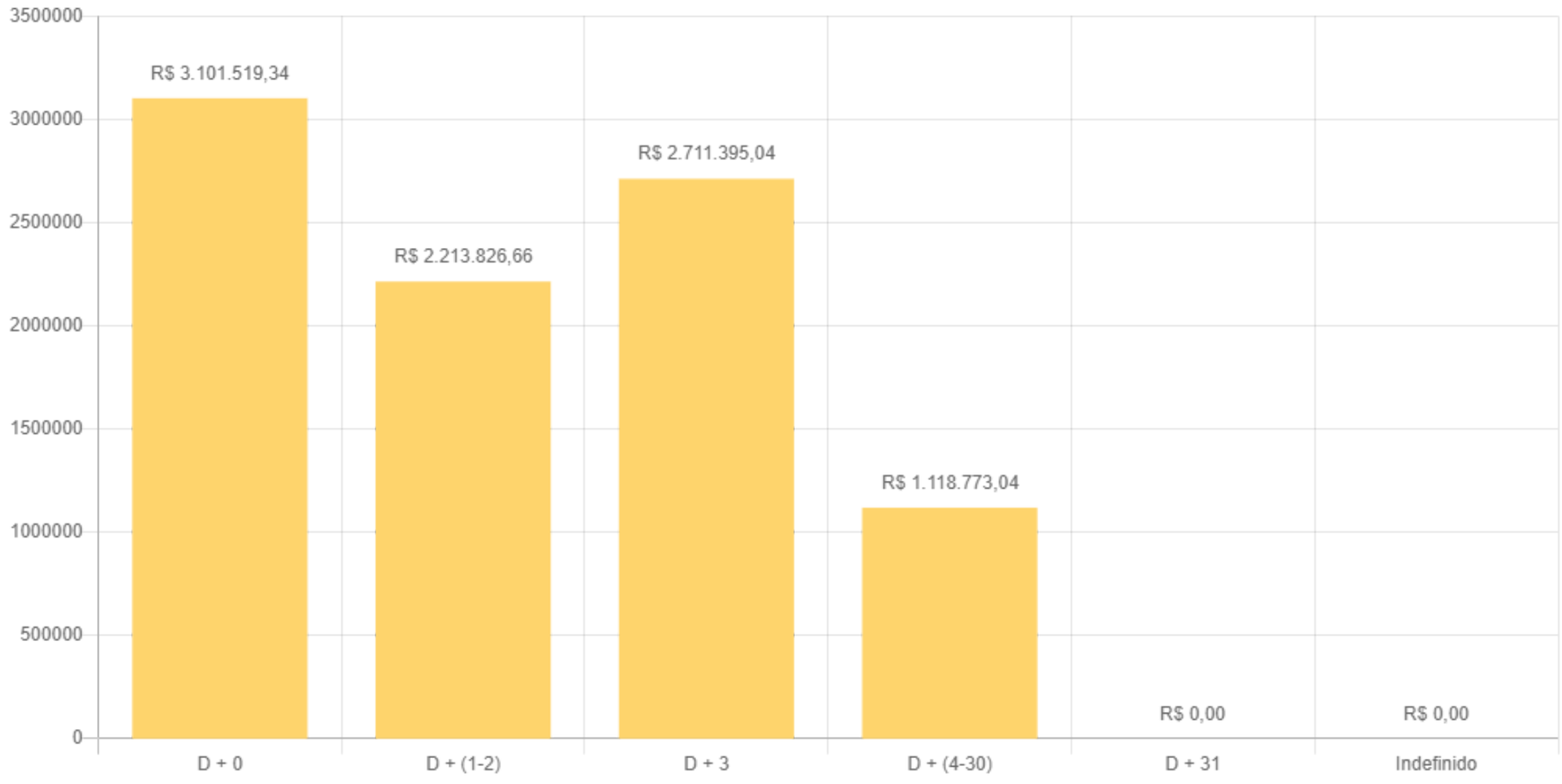
Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.327.340/0001-73	IMA-B 5+	R$ 213.943,09	42,441467%	35,094907%	R$ 90,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	R$ 507.437,49	0,449798%	25,604937%	R$ 2,28
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	R$ 692.723,50	20,488793%	16,580749%	R$ 141,93
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M 1	R$ 51.585,61	1,279152%	15,607685%	R$ 0,66
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS - FUNDO DE INVESTIMENTO	02.887.290/0001-62	IBX-50	R$ 1.323.206,24	162,995560%	73,917632%	R$ 2.156,77
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	23.731.629/0001-07	IBX-50	R$ 1.118.773,04	304,452633%	162,055820%	R$ 3.406,13
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIM	21.838.150/0001-49	CDI	R$ 163.811,47	2,419188%	25,306170%	R$ 3,96

Risco de mercado	
Saldo Total	R$ 9.145.514,08
Provisão para perda e Investimentos:	R$ 9.314,21
% Provisão de perda	0,1018%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	5,0922%

Risco de liquidez

Fundo	Saldo	Participação	Num. Cotistas	% sobre o PL	Patrimonio	Resolução	Grau Risco	Tipo	Prazo Resgate
Total	**R$ 0,00**								

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	5	33,9130%	R$ 3.101.519,34
D + 1	4	21,8674%	R$ 1.999.883,57
D + 2	1	2,3393%	R$ 213.943,09
D + 24	1	12,2330%	R$ 1.118.773,04
D + 4	3	29,6473%	R$ 2.711.395,04



Risco crédito

Risco crédito	% carteira	Saldo

Risco crédito	% carteira	Saldo
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	185,54%	