

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 25/02/2022

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,31%	2,15%	4,31%	6,70%	14,12%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	1,17%	1,89%	4,12%	6,30%	13,19%	1,15%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,17%	1,88%	4,11%	6,26%	13,10%	1,13%	0,03%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,48%	-0,02%	2,26%	0,18%	-1,69%	1,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	-0,09%	2,18%	-0,02%	-2,12%	0,50%	1,89%	0,06%

IMA-B 5+ (Benchmark)	0,01%	-1,60%	-1,93%	-2,75%	-4,23%	-3,33%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	-1,60%	-1,93%	-2,98%	-4,67%	-3,94%	2,65%	0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	-1,65%	-1,97%	-2,92%	-4,52%	-4,01%	2,67%	0,07%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

IRF-M 1 (Benchmark)	0,74%	1,38%	2,27%	2,93%	4,26%	7,47%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,36%	2,21%	2,84%	4,00%	6,81%	0,32%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,06%	1,18%	1,97%	4,26%	6,32%	12,94%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	1,14%	1,92%	4,15%	6,07%	12,36%	1,06%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,54%	-0,19%	0,03%	0,73%	0,92%	4,12%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	-0,24%	-0,04%	0,58%	0,65%	3,56%	1,77%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	-0,23%	-0,03%	0,61%	0,65%	3,48%	1,78%	0,05%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 25/02/2022

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

IRF-M (Benchmark)	0,58%	0,50%	2,40%	1,16%	0,48%	3,51%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,52%	2,40%	1,12%	0,24%	3,13%	1,23%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,44%	2,33%	1,00%	0,13%	2,89%	1,22%	0,04%

CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,63%	1,25%	1,88%	3,10%	4,41%	6,00%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	1,68%	2,47%	4,06%	5,80%	7,96%	0,06%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	0,86%	1,63%	2,38%	2,83%	-	0,60%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	1,59%	2,40%	4,02%	6,01%	8,16%	0,02%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,68%	1,33%	2,01%	3,30%	4,51%	5,83%	0,02%	0,01%

IPCA (Benchmark)	1,01%	1,56%	2,30%	5,77%	10,54%	16,29%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,92%	1,74%	2,50%	3,80%	2,90%	-	0,12%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	1,70%	2,29%	4,89%	8,08%	13,76%	0,44%	0,02%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 25/02/2022

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,71%	1,42%	2,17%	3,74%	5,48%	9,75%	0,08%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,96%	3,66%	4,98%	1,92%	4,59%	8,27%	1,87%	0,05%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	1,73%	3,10%	2,94%	3,80%	-	0,76%	0,02%

Ibovespa (Benchmark)	0,89%	7,94%	11,02%	-4,75%	2,82%	8,61%	-	-
BB FI AÇÕES	7,62%	21,57%	10,69%	17,55%	30,55%	-19,18%	13,91%	0,28%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,38%	1,02%	6,86%	-3,85%	10,64%	15,85%	5,27%	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-1,43%	15,12%	10,55%	-7,83%	-2,25%	-14,38%	8,71%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,37%	3,30%	7,52%	-1,86%	9,72%	16,21%	6,03%	0,14%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,56%	7,33%	10,66%	-5,65%	-0,38%	1,38%	5,92%	0,16%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3,44%	15,05%	14,18%	24,59%	-4,82%	-21,43%	12,64%	0,24%