

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,85%	6,35%	4,97%	7,23%	9,24%	18,49%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,85%	6,18%	4,95%	6,94%	9,11%	17,79%	1,21%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	6,17%	4,95%	6,92%	9,45%	17,95%	1,16%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,39%	0,65%	0,67%	2,95%	-0,89%	-1,17%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37%	0,57%	0,66%	2,85%	-1,22%	-1,68%	2,20%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	1,16%	3,17%	4,84%	2,82%	-0,25%	10,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	3,08%	4,75%	2,73%	-0,76%	9,69%	3,60%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	2,99%	4,72%	2,65%	-0,64%	9,58%	3,57%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,95%	4,02%	2,61%	4,93%	6,43%	8,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	3,90%	2,51%	4,78%	6,14%	7,98%	0,20%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,78%	6,25%	5,02%	7,09%	9,55%	17,65%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	6,16%	4,96%	6,97%	9,31%	17,06%	1,03%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	0,96%	4,73%	4,93%	4,96%	4,59%	14,18%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,97%	4,65%	4,89%	4,87%	4,33%	13,64%	2,20%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	4,58%	4,83%	4,80%	4,24%	13,52%	2,15%	0,06%



CRÉDITO
& MERCADO

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2022

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

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

IRF-M (Benchmark)	0,58%	1,82%	1,31%	3,74%	1,60%	2,33%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	1,80%	1,27%	3,70%	1,47%	1,97%	1,51%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	1,77%	1,32%	3,68%	1,34%	1,86%	1,52%	0,04%

CDI (Benchmark)	1,03%	4,34%	2,81%	5,14%	7,89%	10,24%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	4,45%	2,73%	5,26%	8,07%	9,89%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,89%	3,68%	2,41%	4,34%	6,44%	7,84%	0,01%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	3,82%	2,93%	4,61%	4,84%	9,19%	0,80%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	4,47%	2,84%	5,31%	8,23%	10,70%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95%	3,90%	2,53%	4,60%	6,73%	7,86%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,47%	4,78%	3,18%	5,55%	11,73%	20,73%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,27%	4,86%	3,06%	5,64%	4,95%	7,95%	1,15%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	6,84%	5,06%	7,47%	11,82%	19,48%	0,72%	0,03%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,03%	4,34%	2,81%	5,14%	7,89%	10,24%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,63%	5,81%	2,08%	7,16%	3,00%	13,92%	2,76%	0,06%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,08%	5,07%	3,28%	6,48%	6,02%	9,66%	0,66%	0,02%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,88%	4,17%	2,71%	4,93%	7,65%	11,76%	0,22%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	3,22%	6,23%	-1,58%	9,26%	-11,78%	27,40%	-	-
BB FI AÇÕES	12,02%	32,21%	8,76%	20,39%	17,55%	32,81%	14,53%	0,27%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	6,10%	15,28%	0,14%	10,71%	-14,06%	17,86%	9,92%	0,27%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,07%	7,71%	6,63%	13,94%	-5,96%	47,16%	8,29%	0,14%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,84%	3,48%	0,17%	7,70%	-6,44%	36,97%	7,92%	0,14%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,61%	6,78%	-0,52%	10,08%	-12,44%	25,84%	9,45%	0,18%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	5,52%	33,58%	16,11%	32,57%	20,50%	15,38%	10,52%	0,24%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2022

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-4,32%	-28,18%	-14,52%	-26,95%	-13,03%	16,64%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,68%	-27,08%	-13,51%	-24,90%	-12,31%	15,07%	10,27%	20,138%