

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	6,53%	0,11%	2,61%	8,47%	14,89%	1,50%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	1,58%	6,25%	5,47%	5,41%	7,24%	3,87%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	5,99%	5,34%	5,23%	6,90%	3,28%	2,43%	0,06%

IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	5,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,56%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	4,93%	2,93%	3,00%	4,78%	7,89%	3,62%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,36%	4,82%	2,92%	2,95%	4,83%	7,86%	3,63%	0,08%

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

<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	8,39%	3,37%	6,02%	9,57%	11,94%	0,13%	0,02%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,15%	15,36%	1,26%	0,04%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	6,09%	1,76%	3,18%	7,15%	11,91%	2,47%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

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

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	6,84%	4,63%	5,48%	7,83%	6,48%	1,56%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	6,84%	4,60%	5,39%	7,88%	6,53%	1,56%	0,04%

<b>CDI (Benchmark)</b>	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	9,03%	3,33%	6,29%	11,10%	14,29%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,93%	7,61%	2,89%	5,46%	9,21%	11,44%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	9,08%	3,35%	6,35%	11,18%	14,77%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	7,50%	3,07%	5,15%	9,00%	12,03%	1,12%	0,02%

IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,28%	8,63%	3,51%	5,91%	10,29%	11,11%	1,00%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	10,49%	3,10%	6,22%	12,51%	21,16%	0,00%	0,03%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,07%	8,28%	2,86%	5,75%	10,24%	14,02%	0,34%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,04%	8,05%	2,81%	4,58%	10,11%	11,71%	0,68%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,48%	10,32%	6,73%	3,66%	10,21%	16,28%	3,15%	0,07%

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

Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-6,00%	36,39%	5,82%	7,08%	41,32%	19,49%	13,27%	0,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,71%	5,56%	11,15%	-6,34%	-0,17%	14,77%	10,10%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,22%	3,35%	7,24%	-4,09%	2,20%	30,94%	8,81%	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3,00%	17,92%	16,99%	-4,49%	4,26%	13,93%	11,41%	0,30%
BB FI AÇÕES	-7,05%	42,96%	17,88%	15,89%	44,81%	47,97%	14,52%	0,33%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,32%	-29,24%	-3,06%	-12,36%	-20,40%	-4,58%	9,65%	21,431%