

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,11%	5,99%	-0,18%	4,77%	9,08%	14,35%	1,43%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	6,17%	0,00%	4,95%	9,27%	14,82%	1,44%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	2,60%	4,60%	3,92%	4,62%	4,80%	1,32%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,57%	4,39%	3,80%	4,48%	4,46%	0,72%	2,40%	0,06%

IMA-B 5+ (Benchmark)	2,49%	2,65%	-0,51%	4,31%	1,44%	3,27%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,50%	2,50%	-0,56%	4,16%	1,06%	2,61%	5,17%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,45%	2,41%	-0,56%	4,13%	1,08%	2,59%	5,18%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	7,40%	3,25%	5,94%	9,04%	11,48%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	7,22%	3,20%	5,79%	8,79%	10,79%	0,11%	0,02%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,00%	6,62%	0,35%	5,38%	9,88%	15,12%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	6,58%	0,40%	5,38%	9,75%	14,69%	1,30%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	1,10%	4,57%	-0,15%	4,78%	5,54%	8,99%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	4,40%	-0,17%	4,65%	5,26%	8,45%	3,18%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,20%	4,52%	-0,12%	4,77%	5,40%	8,57%	3,19%	0,06%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2022

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

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

IRF-M (Benchmark)	2,05%	5,49%	3,60%	4,96%	6,17%	4,85%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,04%	5,40%	3,54%	4,86%	6,04%	4,45%	1,48%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	5,38%	3,56%	4,92%	5,97%	4,34%	1,49%	0,04%

CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	7,01%	2,99%	5,60%	9,08%	10,75%	0,01%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	6,17%	2,27%	5,26%	7,77%	9,67%	1,07%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	7,85%	3,25%	6,07%	10,38%	12,85%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,02%	6,61%	2,83%	5,30%	8,56%	10,50%	0,00%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	7,90%	3,28%	6,21%	10,49%	13,56%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,57%	7,26%	2,29%	5,42%	9,43%	9,06%	0,73%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	9,35%	2,34%	7,52%	12,78%	20,13%	0,06%	0,03%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,55%	8,72%	2,75%	4,88%	6,90%	12,24%	2,30%	0,07%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,99%	7,13%	2,84%	5,63%	9,58%	13,15%	0,24%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,09%	6,93%	1,77%	5,11%	8,21%	9,93%	0,74%	0,02%

Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7,56%	7,40%	0,58%	0,06%	-5,60%	11,66%	9,56%	0,23%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,37%	6,78%	-0,86%	5,71%	1,64%	31,94%	6,69%	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	9,80%	14,48%	-0,69%	-0,55%	-8,34%	3,28%	9,75%	0,32%
BB FI AÇÕES	17,87%	53,79%	16,33%	26,51%	48,71%	44,72%	15,89%	0,32%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,77%	-0,18%	-3,54%	-3,37%	-5,17%	19,86%	9,11%	0,20%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	1,00%	45,09%	8,61%	26,11%	57,12%	16,83%	10,16%	0,21%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,02%	-24,46%	3,59%	-10,41%	-14,42%	-0,51%	11,53%	20,927%