

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,54%	3,88%	3,88%	5,80%	9,10%	18,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,63%	3,82%	3,82%	5,71%	8,69%	17,87%	1,46%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,62%	3,82%	3,82%	5,75%	8,64%	18,02%	1,43%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,81%	0,79%	0,79%	1,73%	0,56%	2,39%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	0,73%	0,73%	1,59%	0,17%	1,78%	3,01%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	3,56%	1,91%	1,91%	1,99%	0,35%	12,40%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,53%	1,88%	1,88%	1,73%	-0,11%	11,63%	4,23%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,52%	1,82%	1,82%	1,82%	0,03%	11,52%	4,23%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,89%	2,28%	2,28%	3,43%	5,14%	7,77%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	2,24%	2,24%	3,36%	4,88%	7,10%	0,33%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	2,61%	3,81%	3,81%	5,92%	8,72%	17,96%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,59%	3,76%	3,76%	5,80%	8,48%	17,37%	1,34%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,06%	2,82%	2,82%	3,85%	4,23%	14,81%	2,68%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,01%	2,76%	2,76%	3,77%	4,18%	14,69%	2,67%	0,06%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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

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

IRF-M (Benchmark)	0,84%	1,35%	1,35%	2,35%	2,19%	4,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,85%	1,38%	1,38%	2,36%	2,00%	4,12%	1,92%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	1,29%	1,29%	2,24%	1,85%	3,88%	1,92%	0,04%

CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,79%	2,04%	2,04%	3,56%	5,11%	6,55%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	2,57%	2,57%	4,53%	6,56%	8,53%	0,03%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,36%	2,23%	2,23%	3,66%	4,59%	9,58%	0,92%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,96%	2,57%	2,57%	4,55%	6,77%	9,24%	0,04%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,18%	2,18%	3,79%	5,27%	6,45%	0,01%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,82%	2,57%	2,57%	4,13%	3,40%	-	0,07%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	4,03%	4,03%	5,92%	10,13%	17,95%	0,80%	0,03%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,67%	6,43%	6,43%	6,32%	5,71%	21,42%	2,89%	0,05%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,55%	3,31%	3,31%	5,29%	5,84%	8,54%	0,94%	0,02%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,95%	2,39%	2,39%	4,25%	6,26%	10,94%	0,10%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	10,70%	27,37%	27,37%	31,97%	10,63%	11,60%	9,50%	0,26%
BB FI AÇÕES	1,47%	23,35%	23,35%	24,95%	21,81%	36,68%	14,27%	0,27%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	7,25%	23,46%	23,46%	9,16%	-1,19%	36,16%	12,92%	0,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,67%	7,76%	7,76%	6,56%	9,88%	76,28%	9,48%	0,18%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,00%	12,71%	12,71%	6,59%	0,34%	55,80%	9,07%	0,16%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,24%	-19,26%	-19,26%	-9,18%	-5,10%	50,91%	11,07%	19,140%