

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	6,46%	2,54%	6,46%	9,85%	16,85%	1,38%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,09%	0,73%	-0,06%	0,73%	-1,02%	-2,10%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	0,62%	-0,11%	0,62%	-1,34%	-2,63%	2,55%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,10%	1,85%	0,04%	1,85%	-2,48%	5,42%	3,18%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	1,95%	0,07%	1,95%	-2,61%	5,51%	3,18%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	0,06%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	2,15%	0,76%	2,15%	1,63%	1,54%	1,76%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	2,11%	0,81%	2,11%	1,51%	1,42%	1,76%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,52%	2,87%	5,52%	8,84%	10,78%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	0,02%

IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,77%	18,68%	1,42%	0,03%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,31%	3,37%	-2,88%	3,37%	0,22%	8,47%	2,56%	0,06%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,05%	5,26%	2,81%	5,26%	8,48%	12,36%	0,21%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,03%	5,10%	1,73%	5,10%	5,87%	9,14%	0,71%	0,02%

Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-12,57%	0,79%	-18,36%	0,79%	-24,34%	-8,66%	8,28%	0,29%
BB FI AÇÕES	-8,27%	21,27%	-1,69%	21,27%	12,00%	17,06%	10,00%	0,28%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-3,52%	28,88%	1,19%	28,88%	17,94%	3,38%	9,71%	0,25%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	0,20%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,10%	-27,01%	-9,59%	-27,01%	-10,20%	11,63%	11,56%	20,108%