

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/07/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,17%	6,66%	1,15%	6,61%	10,11%	16,59%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	6,10%	0,78%	6,08%	9,41%	15,38%	1,48%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	6,22%	0,82%	6,21%	9,51%	15,66%	1,40%	0,04%

IRF-M 1+ (Benchmark)	1,20%	1,94%	1,68%	2,45%	1,01%	-2,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	1,77%	1,57%	2,32%	0,67%	-2,96%	2,32%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,84%	0,16%	-1,79%	1,79%	-3,22%	-2,89%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86%	-0,04%	-1,86%	1,62%	-3,54%	-3,55%	3,92%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91%	0,00%	-1,88%	1,65%	-3,73%	-3,54%	3,99%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	1,05%	6,09%	2,96%	5,43%	8,11%	10,26%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	5,95%	2,91%	5,30%	7,86%	9,57%	0,25%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,01%	6,62%	1,13%	6,50%	10,04%	15,61%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	6,53%	1,12%	6,44%	9,84%	15,08%	1,21%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	-0,88%	3,43%	-0,28%	4,20%	3,25%	5,86%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,93%	3,29%	-0,35%	4,08%	2,97%	5,33%	2,47%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89%	3,29%	-0,29%	4,09%	2,96%	5,30%	2,40%	0,06%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/07/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,15%	3,36%	2,11%	3,45%	3,42%	1,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	3,29%	2,07%	3,37%	3,25%	1,57%	1,47%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	3,27%	2,06%	3,40%	3,17%	1,42%	1,48%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04%	6,64%	3,16%	5,81%	9,68%	12,43%	0,01%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,87%	2,86%	5,18%	8,24%	9,65%	0,00%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	4,97%	2,04%	4,77%	6,06%	7,29%	0,65%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	6,60%	3,15%	5,76%	9,53%	11,70%	0,02%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90%	5,54%	2,69%	4,90%	7,81%	9,49%	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,68%	4,77%	0,46%	4,21%	10,07%	19,97%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,06%	1,79%	7,45%	11,96%	19,27%	0,77%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,62%	5,60%	1,98%	4,75%	6,22%	6,99%	1,42%	0,02%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/07/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,78%	6,08%	2,74%	5,34%	8,97%	12,52%	0,34%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,65%	5,78%	1,77%	5,02%	6,86%	9,09%	0,84%	0,02%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,57%	4,99%	0,85%	2,26%	2,65%	7,55%	2,61%	0,06%

Ibovespa (Benchmark)	4,69%	-1,58%	-4,37%	-8,01%	-15,30%	0,25%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,16%	0,39%	-3,94%	-1,00%	-7,27%	18,96%	6,99%	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3,45%	4,26%	-4,04%	-10,72%	-18,50%	-13,38%	9,01%	0,30%
BB FI AÇÕES	7,59%	30,48%	10,56%	15,51%	22,59%	20,80%	8,67%	0,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,17%	-4,72%	-4,39%	-8,10%	-11,12%	10,34%	6,78%	0,19%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	11,46%	43,65%	13,47%	29,15%	42,25%	13,09%	12,10%	0,24%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,13%	-0,15%	-3,11%	-6,46%	-15,16%	0,40%	7,94%	0,21%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/07/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,65%	-22,08%	3,82%	-13,58%	-10,66%	19,00%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,83%	-21,29%	3,97%	-12,02%	-8,08%	19,02%	9,82%	21,061%