

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 |
|--|-----|-----|----|----|-----|-----|---------|------------------|
|--|-----|-----|----|----|-----|-----|---------|------------------|

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IRF-M 1 (Benchmark) | 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% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IMA-B 5 (Benchmark) | 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% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IMA-B (Benchmark) | 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 |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IRF-M (Benchmark) | 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% |
| CDI (Benchmark) | 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 |
|---|--------|---------|--------|---------|---------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | -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% |