

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,78%	8,84%	2,04%	3,22%	12,50%	17,69%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,85%	8,72%	2,35%	3,19%	12,14%	17,05%	0,82%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,83%	8,48%	2,24%	3,04%	11,90%	16,82%	0,85%	0,03%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,92%	7,22%	5,18%	6,95%	12,08%	5,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	6,90%	5,04%	6,69%	11,72%	4,75%	1,43%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	0,65%	5,79%	5,62%	3,73%	10,15%	9,03%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	5,61%	5,60%	3,62%	9,83%	8,35%	2,41%	0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	5,50%	5,54%	3,57%	9,82%	8,34%	2,42%	0,07%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	1,00%	9,68%	3,38%	6,44%	11,52%	13,50%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,45%	3,31%	6,32%	11,23%	12,92%	0,04%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,91%	9,12%	2,35%	3,50%	12,73%	17,73%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,88%	9,05%	2,36%	3,51%	12,60%	17,31%	0,75%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	1,23%	7,43%	3,86%	3,57%	11,40%	13,44%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	7,34%	3,92%	3,56%	11,26%	13,01%	1,58%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	7,18%	3,77%	3,47%	11,10%	12,87%	1,55%	0,05%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,93%	7,95%	4,44%	6,64%	11,95%	8,26%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94%	7,84%	4,41%	6,56%	11,85%	7,91%	0,96%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	7,79%	4,38%	6,53%	11,79%	7,77%	0,96%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,02%	10,00%	3,30%	6,51%	11,49%	15,20%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,89%	8,56%	2,87%	5,64%	9,77%	12,33%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04%	10,21%	3,35%	6,62%	11,79%	15,78%	0,01%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95%	9,10%	3,06%	6,01%	10,39%	12,85%	0,00%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	8,59%	3,46%	5,57%	11,11%	13,25%	0,73%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	10,13%	3,32%	6,57%	11,65%	15,31%	0,02%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,59%	4,70%	-0,06%	0,39%	6,47%	17,83%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,96%	9,68%	3,86%	5,92%	11,28%	12,31%	0,60%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	11,60%	3,28%	5,13%	14,20%	21,77%	0,00%	0,02%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,02%	10,00%	3,30%	6,51%	11,49%	15,20%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,29%	12,85%	7,49%	8,40%	14,42%	19,40%	4,78%	0,06%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,00%	9,36%	3,09%	5,91%	10,92%	14,97%	0,14%	0,00%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,40%	3,42%	5,24%	11,56%	13,53%	0,77%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	5,45%	10,70%	12,48%	7,57%	12,11%	23,51%	-	-
BB FI AÇÕES	-4,03%	37,19%	5,14%	16,24%	41,04%	41,34%	29,50%	0,33%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,61%	2,04%	7,10%	2,39%	5,28%	25,87%	14,36%	0,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	9,32%	8,90%	4,61%	15,03%	37,52%	12,63%	0,18%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	6,60%	25,70%	20,56%	15,69%	18,13%	21,69%	17,72%	0,30%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	11,57%	52,17%	5,93%	20,20%	42,63%	36,81%	14,81%	0,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,18%	8,92%	9,09%	5,69%	10,41%	19,46%	14,31%	0,20%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,33%	-29,86%	-9,99%	-6,55%	-29,14%	-2,97%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,41%	-26,12%	-6,13%	-2,40%	-24,89%	1,39%	14,96%	18,165%