

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,77%	8,00%	1,63%	1,56%	8,90%	15,34%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,71%	7,71%	1,63%	1,45%	8,49%	14,60%	2,08%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,65%	8,01%	1,72%	1,72%	8,77%	14,75%	1,98%	0,03%

IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,42%	5,70%	1,06%	5,02%	8,12%	3,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,49%	5,31%	0,88%	4,71%	7,69%	2,74%	4,85%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,18%	4,54%	1,85%	1,33%	4,19%	5,03%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25%	4,19%	1,73%	1,16%	3,84%	4,38%	6,75%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,20%	4,34%	1,80%	1,23%	3,99%	4,38%	6,73%	0,06%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,94%	10,71%	3,09%	6,43%	11,68%	14,31%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	10,45%	3,01%	6,31%	11,39%	13,72%	0,19%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,33%	8,76%	2,00%	2,36%	9,62%	15,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,35%	8,67%	1,95%	2,36%	9,50%	15,42%	1,96%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	-0,79%	6,58%	1,92%	1,77%	6,82%	10,34%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,83%	6,45%	1,84%	1,72%	6,67%	9,89%	4,52%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	6,33%	1,84%	1,67%	6,54%	9,78%	4,44%	0,04%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	-0,66%	7,24%	1,66%	5,33%	9,26%	7,16%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,62%	7,18%	1,68%	5,28%	9,18%	6,89%	3,28%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	7,05%	1,58%	5,19%	9,06%	6,66%	3,35%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,88%	9,52%	2,73%	5,63%	10,21%	13,23%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	11,21%	3,12%	6,47%	12,07%	16,33%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,02%	11,34%	3,19%	6,57%	12,23%	16,78%	0,02%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,94%	10,12%	2,91%	5,99%	10,86%	13,84%	0,00%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	8,47%	2,16%	4,48%	9,29%	11,99%	2,39%	0,02%

IPCA (Benchmark)	0,41%	5,13%	0,71%	0,33%	5,90%	17,27%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	-0,20%	9,46%	2,06%	4,39%	10,28%	11,33%	1,79%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	12,72%	3,09%	5,50%	13,38%	21,57%	0,00%	0,02%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,87%	11,87%	2,90%	5,73%	13,30%	13,79%	4,28%	0,07%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,88%	10,32%	2,98%	5,91%	11,13%	15,51%	0,11%	0,00%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,45%	9,88%	2,76%	4,58%	11,35%	13,01%	0,87%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	-3,06%	7,31%	2,71%	1,02%	10,37%	3,30%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,18%	6,55%	-0,79%	-0,22%	9,84%	0,74%	12,13%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,88%	5,08%	-1,60%	-2,45%	11,15%	18,17%	14,35%	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-12,60%	9,85%	-4,04%	-4,71%	5,50%	-8,91%	15,72%	0,33%
BB FI AÇÕES	-2,58%	33,65%	-13,10%	1,09%	21,70%	20,76%	15,46%	0,32%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,00%	-1,02%	-0,85%	-4,35%	3,02%	4,37%	13,50%	0,19%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	5,33%	60,27%	10,46%	19,98%	59,06%	19,81%	14,19%	0,22%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,09%	-24,89%	-0,58%	4,59%	-23,60%	1,33%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,41%	-21,38%	4,07%	7,81%	-19,03%	5,66%	20,07%	20,125%