

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	2,93%	4,20%	5,90%	10,95%	17,94%	1,47%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49%	2,95%	4,20%	6,00%	11,25%	18,21%	1,45%	0,03%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,79%	1,51%	3,16%	4,25%	9,06%	7,22%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	1,48%	3,07%	3,98%	8,64%	6,34%	2,41%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	1,17%	-0,11%	-1,30%	0,52%	4,86%	0,42%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	-0,13%	-1,31%	0,40%	4,54%	-0,18%	3,89%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	-0,16%	-1,39%	0,39%	4,57%	-0,32%	3,94%	0,06%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,98%	2,09%	3,30%	6,49%	12,81%	17,61%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	2,03%	3,21%	6,32%	12,47%	16,97%	0,32%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	18,62%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,79%	3,73%	5,76%	11,45%	18,22%	1,18%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	1,28%	1,28%	1,08%	3,02%	7,94%	8,94%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,26%	1,22%	0,98%	2,84%	7,75%	8,45%	2,48%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	1,26%	1,04%	2,90%	7,68%	8,38%	2,45%	0,04%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,86%	1,71%	3,21%	4,93%	10,13%	10,66%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	1,72%	3,19%	4,92%	10,02%	10,29%	1,59%	0,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	1,65%	3,10%	4,73%	9,88%	10,03%	1,59%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	1,63%	2,41%	4,63%	10,13%	13,25%	1,21%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,79%	1,76%	2,74%	5,54%	11,14%	16,04%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	2,06%	3,17%	6,39%	12,84%	19,39%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	1,99%	3,13%	6,42%	13,03%	19,82%	0,13%	0,00%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	1,89%	2,95%	5,94%	11,87%	16,92%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	2,01%	3,15%	6,33%	14,33%	23,57%	0,00%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,75%	4,11%	6,04%	10,88%	-	1,28%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,99%	1,99%	3,21%	5,33%	11,04%	14,26%	0,44%	0,02%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,99%	2,95%	5,79%	11,20%	15,43%	0,69%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,89%	-0,21%	-0,07%	2,83%	7,85%	12,80%	2,75%	0,07%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,87%	1,79%	2,82%	5,89%	11,84%	17,97%	0,19%	0,00%

Ibovespa (Benchmark)	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-4,55%	6,78%	14,65%	26,65%	59,71%	52,02%	13,50%	0,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-6,41%	-3,30%	-5,92%	-6,67%	-6,62%	-6,97%	8,21%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,85%	-2,74%	-5,15%	-6,66%	-1,33%	9,16%	7,56%	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-5,55%	-4,20%	-4,23%	-8,10%	-8,61%	-10,66%	13,14%	0,28%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FI AÇÕES	0,94%	18,02%	17,30%	1,94%	28,97%	68,37%	11,38%	0,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-7,34%	-4,24%	-6,62%	-7,40%	-10,52%	-1,82%	8,82%	0,20%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,38%	2,36%	-2,54%	1,43%	-9,13%	-6,49%	7,60%	17,154%