

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,56%	2,10%	6,56%	9,43%	20,20%	0,78%	0,03%

IRF-M 1+ (Benchmark)	2,65%	11,41%	6,89%	11,41%	18,80%	17,59%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,63%	11,25%	6,86%	11,25%	18,26%	16,67%	1,37%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	3,37%	14,91%	10,90%	14,91%	16,34%	13,82%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,30%	14,47%	10,61%	14,47%	15,72%	12,70%	3,08%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,31%	14,66%	10,79%	14,66%	15,89%	13,02%	3,16%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	0,04%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

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

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

IRF-M (Benchmark)	2,12%	9,62%	5,52%	9,62%	16,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,10%	9,56%	5,47%	9,56%	16,61%	18,51%	0,90%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	9,44%	5,43%	9,44%	16,38%	18,13%	0,90%	0,03%

CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,99%	5,64%	2,77%	5,64%	11,68%	19,63%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	6,44%	3,16%	6,44%	13,54%	23,74%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	8,76%	5,04%	8,76%	13,97%	19,98%	0,95%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13%	6,55%	3,23%	6,55%	13,52%	23,55%	0,04%	0,00%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,69%	7,76%	4,31%	7,76%	13,75%	19,35%	0,56%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,56%	1,44%	5,56%	8,39%	-	0,47%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	6,37%	3,08%	6,37%	13,12%	26,43%	0,00%	0,00%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,64%	6,01%	5,71%	6,01%	14,89%	15,14%	2,12%	0,05%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,19%	6,37%	3,23%	6,37%	12,61%	22,16%	0,16%	0,00%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,94%	6,56%	2,81%	6,56%	12,47%	19,07%	0,61%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-0,67%	-4,36%	-5,67%	-4,36%	27,69%	50,60%	7,41%	0,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8,37%	6,56%	13,83%	6,56%	16,30%	-10,29%	7,19%	0,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,77%	13,72%	19,95%	13,72%	20,91%	2,63%	8,04%	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	9,96%	17,85%	24,88%	17,85%	28,42%	-2,84%	7,53%	0,23%
BB FI AÇÕES	12,93%	48,42%	28,45%	48,42%	62,57%	82,08%	13,24%	0,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,18%	4,06%	12,50%	4,06%	9,82%	-8,47%	7,42%	0,15%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,47%	7,68%	4,07%	7,68%	10,43%	-0,84%	6,71%	15,073%