

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

Rentabilidade dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,45%	12,13%	2,89%	5,00%	12,13%	22,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	11,90%	2,86%	4,97%	11,90%	22,02%	0,43%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	11,72%	2,89%	4,84%	11,72%	22,14%	0,45%	0,02%

IRF-M 1+ (Benchmark)	1,73%	18,52%	5,05%	6,37%	18,52%	27,30%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,71%	18,19%	5,00%	6,24%	18,19%	26,41%	0,94%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	3,94%	19,28%	6,42%	3,80%	19,28%	23,21%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,93%	18,87%	6,38%	3,67%	18,87%	22,37%	2,40%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	18,90%	6,40%	3,87%	18,90%	22,53%	2,38%	0,07%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,91%	13,25%	2,89%	6,16%	13,25%	26,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	12,88%	2,80%	6,00%	12,88%	26,13%	0,04%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	11,96%	2,92%	4,64%	11,96%	22,79%	0,48%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,73%	15,86%	4,71%	4,15%	15,86%	23,03%	1,44%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	0,04%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

Rentabilidade dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	16,06%	4,33%	6,05%	16,06%	26,02%	0,66%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	16,32%	4,33%	6,17%	16,32%	26,46%	0,66%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	11,58%	2,59%	5,63%	11,58%	23,39%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,93%	2,58%	5,62%	11,93%	24,53%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	14,99%	2,92%	5,73%	14,99%	25,68%	0,06%	0,02%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	12,98%	2,79%	6,04%	12,98%	27,02%	0,01%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,46%	4,52%	0,99%	1,60%	4,52%	10,57%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,98%	12,80%	2,54%	4,68%	12,80%	24,96%	0,07%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	11,17%	2,16%	5,32%	11,17%	-	0,34%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	12,76%	2,77%	6,01%	12,76%	28,52%	0,01%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	-	2,19%	5,37%	-	-	0,34%	-

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,94%	12,74%	3,13%	6,00%	12,74%	25,64%	0,14%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,23%	12,36%	3,60%	5,44%	12,36%	24,64%	0,42%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,04%	14,50%	5,96%	8,00%	14,50%	28,27%	1,91%	0,05%

Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	6,28%	20,87%	7,54%	7,76%	20,87%	14,15%	9,33%	0,23%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,66%	27,90%	14,41%	12,47%	27,90%	31,07%	4,77%	0,17%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	7,33%	32,09%	20,69%	12,08%	32,09%	45,06%	7,25%	0,21%
BB FI AÇÕES	2,61%	72,62%	19,22%	16,31%	72,62%	129,31%	8,81%	0,24%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6,04%	16,67%	14,36%	12,12%	16,67%	12,62%	6,09%	0,17%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	7,34%	9,15%	7,44%	14,13%	9,15%	87,83%	7,30%	0,20%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,98%	20,49%	12,86%	13,07%	20,49%	24,89%	5,86%	0,16%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,03%	17,78%	7,61%	9,37%	17,78%	-11,84%	4,59%	14,099%