

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/03/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	2,24%	2,24%	5,19%	9,48%	20,66%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,08%	2,08%	5,00%	9,45%	19,97%	0,52%	1,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	2,05%	2,05%	4,99%	9,24%	20,06%	0,47%	1,63%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,43%	1,37%	1,37%	6,49%	15,26%	28,03%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	1,30%	1,30%	6,37%	15,00%	27,13%	0,97%	3,20%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,55%	-1,51%	-1,51%	4,82%	13,38%	19,08%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,59%	-1,61%	-1,61%	4,67%	13,00%	18,25%	1,71%	6,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,56%	-1,52%	-1,52%	4,78%	13,14%	18,45%	1,68%	5,96%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	2,46%	2,46%	5,42%	12,28%	27,08%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	2,43%	2,43%	5,30%	11,98%	26,36%	0,09%	0,25%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,77%	2,06%	2,06%	5,09%	9,62%	21,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	2,01%	2,01%	4,98%	9,48%	20,72%	0,44%	1,68%

IMA-B (Benchmark)	0,08%	0,18%	0,18%	4,94%	11,81%	20,21%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,11%	0,11%	4,82%	11,56%	19,65%	1,09%	3,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,13%	0,13%	4,84%	11,64%	19,81%	1,08%	3,86%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/03/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,54%	1,68%	1,68%	6,13%	14,03%	27,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,62%	1,62%	6,01%	13,79%	26,76%	0,72%	2,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,61%	1,61%	6,00%	13,61%	26,42%	0,72%	2,21%
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	2,55%	2,55%	5,41%	12,25%	26,99%	0,07%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,75%	2,37%	2,37%	5,02%	11,13%	23,79%	0,01%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	2,65%	2,65%	5,55%	12,40%	27,30%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,38%	2,38%	5,02%	11,27%	24,78%	0,01%	0,06%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	2,41%	2,41%	5,40%	13,73%	25,89%	0,08%	0,99%

IPCA (Benchmark)	0,16%	1,42%	1,42%	2,51%	3,93%	8,76%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	2,56%	2,56%	5,40%	12,07%	26,70%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,62%	2,17%	2,17%	4,77%	11,55%	24,47%	0,45%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	2,81%	2,81%	5,06%	-	-	0,20%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,78%	2,78%	5,01%	9,81%	20,12%	0,20%	0,94%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/03/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	2,62%	2,62%	5,54%	12,36%	27,28%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,84%	2,54%	2,54%	5,74%	12,20%	25,83%	0,05%	0,51%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,72%	1,92%	1,92%	5,59%	10,49%	22,96%	0,53%	1,46%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,24%	0,06%	0,06%	6,01%	14,24%	20,59%	1,71%	4,48%

Ibovespa (Benchmark)	-0,71%	-4,53%	-4,53%	9,90%	25,74%	6,76%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-2,52%	-0,04%	-0,04%	7,40%	7,62%	47,42%	6,70%	17,82%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,18%	-5,46%	-5,46%	6,70%	21,69%	4,77%	5,55%	14,89%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	6,06%	2,45%	2,45%	10,17%	41,59%	5,98%	8,18%	21,42%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,36%	0,85%	0,85%	15,38%	36,06%	22,66%	5,49%	15,78%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-0,13%	-4,95%	-4,95%	14,72%	33,03%	11,68%	5,72%	18,44%
BB FI AÇÕES	-1,49%	4,10%	4,10%	24,11%	55,52%	93,52%	7,53%	21,03%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27%	-4,27%	-4,27%	9,48%	20,76%	-0,83%	5,21%	15,39%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/03/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,24%	13,93%	13,93%	22,60%	29,68%	24,40%	5,80%	13,276%