

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,41%	6,27%	1,80%	4,09%	9,45%	20,22%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	2,34%	1,46%	1,61%	5,43%	-	1,93%	3,35%
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,13%	-3,26%	-1,37%	-1,21%	-0,35%	-	5,27%	5,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,61%	-	1,52%	-	-	-	1,28%	-

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	4,32%	1,52%	3,11%	7,68%	20,09%	1,34%	1,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	4,56%	1,66%	3,36%	7,81%	20,28%	1,25%	1,83%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,60%	2,39%	1,43%	1,43%	7,39%	24,61%	-	-
-----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	2,21%	1,37%	1,30%	7,14%	23,78%	2,30%	3,77%

IMA-B 5+ (Benchmark)	0,77%	-1,21%	1,69%	-0,25%	3,11%	18,58%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	-1,30%	1,65%	-0,34%	3,06%	17,99%	3,76%	6,40%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	-1,44%	1,60%	-0,42%	2,80%	17,77%	3,79%	6,46%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,77%	6,30%	2,36%	4,62%	10,39%	25,57%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	6,13%	2,27%	4,45%	10,09%	24,84%	0,30%	0,40%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	4,74%	1,86%	3,45%	7,92%	20,66%	1,09%	1,78%

IMA-B (Benchmark)	0,52%	1,49%	1,63%	1,40%	5,32%	19,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	1,29%	1,54%	1,24%	5,04%	19,17%	2,43%	4,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,33%	1,56%	1,26%	5,08%	19,27%	2,44%	4,09%

IRF-M (Benchmark)	0,66%	3,54%	1,70%	2,39%	8,26%	24,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	3,37%	1,65%	2,24%	8,00%	24,03%	1,62%	2,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	3,37%	1,66%	2,25%	8,00%	23,62%	1,62%	2,68%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,91%	2,38%	4,21%	9,96%	25,37%	0,41%	0,64%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	6,88%	2,58%	5,04%	10,91%	25,87%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,78%	6,37%	2,32%	4,69%	10,11%	23,11%	0,00%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79%	6,39%	2,33%	4,70%	10,11%	23,82%	0,01%	0,05%

IPCA (Benchmark)	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,78%	5,50%	2,25%	3,90%	8,67%	22,91%	0,24%	0,89%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,42%	2,09%	3,80%	2,28%	9,14%	20,44%	2,56%	5,10%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,80%	5,36%	2,19%	3,61%	9,50%	23,56%	0,28%	0,77%

Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,75%	-2,57%	8,19%	1,84%	10,74%	13,30%	5,57%	12,80%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	3,35%	-3,25%	9,33%	0,16%	0,19%	10,30%	12,42%	20,06%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	13,06%	1,48%	17,04%	6,63%	20,38%	28,58%	7,77%	16,62%
BB FI AÇÕES	7,52%	7,08%	7,61%	1,33%	28,63%	59,66%	9,10%	17,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,07%	-0,26%	9,16%	3,91%	14,36%	12,53%	5,46%	13,12%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	8,21%	16,34%	17,47%	13,44%	28,22%	50,61%	7,73%	14,89%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,39%	31,34%	10,76%	17,87%	36,69%	53,29%	9,80%	15,184%