

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,18%	2,04%	4,38%	9,65%	21,10%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,50%	-	1,81%	-	-	-	0,80%	-
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,12%	-3,38%	-1,19%	-1,63%	0,28%	-	1,74%	5,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	2,23%	1,64%	1,19%	6,10%	-	1,75%	3,30%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,39%	5,01%	1,75%	2,72%	8,05%	20,40%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	4,73%	1,72%	2,60%	7,72%	19,96%	0,92%	1,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	5,06%	1,89%	2,95%	8,09%	20,22%	0,82%	1,82%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,11%	2,50%	2,27%	1,11%	7,67%	22,81%	-	-
-----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	2,29%	2,21%	0,98%	7,41%	22,00%	1,96%	3,84%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,42%	-2,62%	2,55%	-1,13%	3,64%	14,16%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,43%	-2,71%	2,50%	-1,20%	3,52%	13,61%	2,55%	6,12%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,46%	-2,88%	2,46%	-1,29%	3,31%	13,37%	2,58%	6,17%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	6,98%	2,47%	4,44%	9,98%	24,49%	0,14%	0,41%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	-	-
----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,14%	1,87%	3,07%	8,21%	20,61%	0,96%	1,77%

IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,69%	0,63%	1,88%	0,50%	5,37%	16,71%	1,87%	3,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	0,60%	1,84%	0,49%	5,34%	16,66%	1,86%	3,95%

IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	3,70%	2,31%	2,06%	8,19%	22,33%	1,35%	2,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,32%	3,70%	2,30%	2,05%	8,19%	22,74%	1,35%	2,72%

CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,75%	7,17%	2,36%	4,69%	9,95%	22,88%	0,00%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,84%	8,11%	2,73%	5,33%	11,17%	26,08%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	6,66%	2,71%	4,15%	9,77%	24,69%	0,18%	0,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	7,77%	2,64%	5,08%	10,77%	25,55%	0,02%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,72%	6,27%	2,38%	4,01%	8,97%	22,23%	0,38%	0,85%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,08%	0,99%	2,96%	0,93%	7,00%	17,41%	2,65%	5,19%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,74%	6,13%	2,42%	3,51%	9,45%	23,16%	0,11%	0,76%

Ibovespa (Benchmark)	-3,08%	-1,77%	6,38%	2,90%	13,08%	19,79%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	6,56%	15,64%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-5,83%	-4,44%	9,62%	0,54%	15,34%	17,56%	6,61%	16,19%
BB FI AÇÕES	-2,80%	4,08%	3,76%	-0,02%	24,08%	66,95%	6,99%	17,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,70%	-3,95%	3,95%	0,33%	9,85%	9,84%	5,58%	12,70%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-3,44%	12,33%	11,40%	12,37%	20,69%	54,71%	5,40%	14,53%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,49%	-4,99%	4,82%	0,49%	7,22%	12,41%	5,33%	12,35%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-5,18%	-8,25%	3,49%	-10,44%	-1,34%	2,57%	8,24%	19,91%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,21%	41,96%	0,63%	22,50%	52,98%	86,40%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,17%	31,57%	1,07%	15,48%	41,58%	63,92%	7,93%	15,469%