

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,49%	8,79%	2,36%	4,21%	9,82%	20,71%	-	-
CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,06%	-3,10%	0,17%	-1,20%	-1,18%	-	1,64%	5,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	2,51%	0,16%	1,62%	4,55%	-	1,65%	3,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,40%	-	1,80%	3,34%	-	-	1,08%	-

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,22%	6,09%	1,42%	2,97%	7,63%	20,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	5,74%	1,36%	2,91%	7,22%	19,78%	1,12%	1,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	6,24%	1,61%	3,30%	7,75%	20,15%	1,08%	1,75%

IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,13%	1,19%	-1,16%	0,25%	2,94%	21,88%	-	-
----------------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,15%	0,94%	-1,25%	0,10%	2,66%	21,17%	2,53%	3,83%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,23%	-4,45%	-3,28%	-1,64%	-0,68%	12,61%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,22%	-4,52%	-3,27%	-1,68%	-0,77%	12,12%	4,40%	5,91%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,23%	-4,71%	-3,31%	-1,76%	-0,96%	11,93%	4,42%	5,96%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,57%	8,70%	2,25%	4,67%	9,69%	24,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	8,44%	2,18%	4,50%	9,40%	23,83%	0,22%	0,43%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,36%	6,46%	1,51%	3,44%	8,02%	20,49%	-	-
----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	6,25%	1,44%	3,33%	7,78%	20,06%	1,07%	1,66%

IMA-B (Benchmark)	0,02%	0,19%	-1,29%	0,32%	2,94%	16,04%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00%	-0,06%	-1,37%	0,18%	2,67%	15,52%	2,97%	3,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	-0,07%	-1,34%	0,17%	2,67%	15,44%	2,97%	3,86%

IRF-M (Benchmark)	-0,52%	3,57%	0,03%	1,73%	5,11%	22,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,54%	3,34%	-0,03%	1,62%	4,85%	21,93%	1,70%	2,69%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,54%	3,34%	-0,04%	1,62%	4,84%	21,66%	1,71%	2,69%

CDI (Benchmark)	0,79%	9,85%	2,58%	5,23%	10,84%	25,58%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	7,94%	1,92%	4,35%	8,97%	25,07%	0,43%	0,68%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	9,67%	2,62%	5,26%	10,66%	25,26%	0,01%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,71%	8,84%	2,32%	4,69%	9,72%	22,61%	0,01%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	10,00%	2,60%	5,35%	10,99%	25,67%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,72%	8,88%	2,34%	4,73%	9,78%	23,13%	0,01%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,12%	4,01%	1,12%	1,70%	4,59%	9,49%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,28%	7,39%	1,79%	4,08%	8,44%	22,59%	0,96%	0,96%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,79%	9,85%	2,58%	5,23%	10,84%	25,58%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,82%	-0,14%	-2,18%	1,53%	1,90%	14,49%	2,84%	5,19%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,45%	7,43%	1,97%	4,20%	8,44%	22,35%	0,32%	0,67%

Ibovespa (Benchmark)	-3,12%	-6,35%	-7,60%	2,92%	-1,31%	11,72%	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-2,27%	5,85%	-9,01%	6,88%	13,63%	24,06%	8,47%	14,50%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,14%	-7,19%	-4,75%	3,06%	-1,64%	8,79%	6,09%	11,61%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-3,72%	-12,69%	-9,76%	-1,34%	-7,21%	3,24%	10,43%	19,49%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,27%	-0,60%	-3,25%	6,61%	6,02%	23,99%	11,96%	15,62%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-7,95%	-14,09%	-15,34%	-0,91%	-7,79%	13,45%	10,05%	15,59%
BB FI AÇÕES	-4,19%	-3,52%	-9,90%	-3,05%	-1,00%	65,53%	9,81%	16,40%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,65%	-6,91%	-6,66%	1,89%	-1,29%	5,93%	6,93%	11,74%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	8,32%	63,02%	14,60%	30,35%	67,66%	97,27%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,59%	50,90%	14,88%	27,24%	55,47%	69,21%	6,99%	15,578%