

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	8,48%	0,84%	3,19%	9,04%	22,01%	1,24%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33%	8,23%	0,62%	3,00%	8,84%	22,05%	1,32%	0,02%

IRF-M 1+ (Benchmark)	0,12%	12,95%	0,56%	7,03%	13,15%	26,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	12,66%	0,46%	6,89%	12,72%	25,93%	2,54%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,98%	10,98%	-4,11%	3,97%	8,37%	19,37%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96%	10,67%	-4,03%	3,84%	8,00%	18,61%	4,57%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	10,64%	-4,17%	3,78%	7,96%	18,56%	4,60%	0,08%

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

IRF-M 1 (Benchmark)	0,96%	11,12%	3,06%	6,61%	13,48%	26,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,82%	2,97%	6,45%	13,13%	25,83%	0,12%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	8,44%	0,39%	3,03%	9,06%	22,79%	1,43%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,66%	9,92%	-1,98%	3,69%	8,75%	20,99%	3,00%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	0,05%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA FIXA

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

IRF-M (Benchmark)	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	11,88%	1,23%	6,56%	12,79%	26,15%	1,78%	0,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	11,64%	1,22%	6,41%	12,46%	25,73%	1,77%	0,03%

CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,67%	2,79%	7,46%	13,41%	26,00%	0,26%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	10,96%	3,07%	6,61%	13,28%	26,47%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,92%	9,76%	2,89%	5,95%	11,80%	22,71%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,00%

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

IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,35%	10,39%	1,43%	5,91%	11,49%	24,07%	0,82%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	10,79%	3,07%	6,41%	13,14%	29,21%	0,00%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	-	2,48%	-	-	-	0,48%	-

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,14%	7,91%	0,15%	6,53%	7,12%	22,57%	2,27%	0,05%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,76%	10,16%	2,53%	6,00%	12,26%	24,52%	0,53%	0,00%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,26%	8,74%	1,03%	4,01%	10,26%	23,01%	1,15%	0,01%

Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-3,48%	3,05%	-6,70%	8,25%	-1,93%	8,28%	6,64%	0,18%
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES	-7,06%	4,46%	-15,03%	13,30%	-8,02%	-0,75%	10,04%	0,26%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,74%	5,39%	-9,05%	8,04%	-1,21%	13,64%	9,24%	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-3,03%	6,13%	-11,10%	4,45%	-7,28%	9,54%	9,17%	0,24%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FI AÇÕES	2,35%	48,20%	2,41%	17,22%	43,50%	102,39%	10,13%	0,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,79%	-1,85%	-9,15%	4,80%	-7,15%	-2,25%	7,84%	0,18%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-1,51%	0,06%	3,58%	-6,36%	13,16%	61,39%	7,02%	0,21%

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,58%	7,72%	-2,12%	4,68%	9,14%	-18,02%	7,88%	19,090%