

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2024

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,07% | 3,03% | 1,78% | 4,53% | 9,23% | 18,78% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,03% | 2,76% | 1,57% | 4,20% | 8,99% | 18,09% | 0,66% | 1,67% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,05% | 2,85% | 1,67% | 4,31% | 8,93% | 18,32% | 0,58% | 1,67% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IRF-M 1+ (Benchmark) | 0,60% | 0,94% | 0,00% | 2,69% | 10,22% | 27,67% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,58% | 0,84% | -0,07% | 2,56% | 9,95% | 26,74% | 1,85% | 3,32% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|--------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IMA-B 5+ (Benchmark) | 1,59% | -2,85% | -1,91% | 0,98% | 4,24% | 16,02% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,56% | -2,90% | -1,95% | 0,92% | 4,18% | 15,43% | 2,05% | 5,90% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,57% | -3,00% | -1,98% | 0,82% | 3,89% | 15,26% | 2,05% | 5,98% |

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

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,78% | 3,85% | 2,21% | 4,80% | 11,56% | 26,65% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,75% | 3,77% | 2,13% | 4,69% | 11,27% | 25,97% | 0,18% | 0,33% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,05% | 2,92% | 1,62% | 4,42% | 8,94% | 19,23% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,03% | 2,83% | 1,56% | 4,31% | 8,70% | 18,94% | 0,55% | 1,72% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|--------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IMA-B (Benchmark) | 1,33% | -0,13% | -0,23% | 2,62% | 6,56% | 17,72% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,30% | -0,23% | -0,30% | 2,49% | 6,35% | 17,30% | 1,28% | 3,83% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,31% | -0,24% | -0,29% | 2,49% | 6,25% | 17,16% | 1,28% | 3,85% |

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2024

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

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

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IRF-M (Benchmark) | 0,66% | 1,81% | 0,67% | 3,32% | 10,51% | 26,78% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,63% | 1,69% | 0,58% | 3,18% | 10,24% | 26,33% | 1,32% | 2,36% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,64% | 1,69% | 0,58% | 3,17% | 10,09% | 25,93% | 1,32% | 2,35% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| CDI (Benchmark) | 0,83% | 4,40% | 2,58% | 5,33% | 12,01% | 27,10% | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,83% | 4,42% | 2,59% | 5,36% | 12,05% | 27,13% | 0,02% | 0,07% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,79% | 4,19% | 2,41% | 5,13% | 11,73% | 26,70% | 0,04% | 0,11% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,75% | 3,96% | 2,32% | 4,81% | 10,90% | 23,72% | 0,00% | 0,06% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,75% | 3,97% | 2,32% | 4,82% | 10,90% | 24,61% | 0,01% | 0,07% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,72% | 3,44% | 1,78% | 4,42% | 11,34% | 25,22% | 0,35% | 0,80% |

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

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IPCA (Benchmark) | 0,46% | 2,27% | 1,00% | 2,84% | 3,93% | 8,02% | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,14% | 0,88% | 0,16% | 2,88% | 6,45% | - | 1,10% | 3,12% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 0,66% | 3,18% | 1,61% | 4,19% | 9,83% | 22,96% | 0,33% | 1,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,89% | 4,51% | 2,62% | 5,48% | 11,10% | 19,57% | 0,65% | 0,86% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,89% | 4,56% | 2,64% | 5,53% | 11,21% | - | 0,65% | 0,86% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,81% | 4,29% | 2,51% | 5,20% | 11,71% | 25,44% | 0,00% | 0,06% |

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2024

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------|---------------|---------------|---------------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,83% | 4,40% | 2,58% | 5,33% | 12,01% | 27,10% | - | - |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | -0,49% | -1,65% | -1,46% | 0,36% | 9,02% | 19,22% | 2,49% | 4,63% |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | 0,59% | 3,10% | 1,39% | 4,07% | 10,58% | 24,35% | 0,43% | 0,74% |

| | | | | | | | | |
|---------------------------------|---------------|----------------|---------------|---------------|--------|---------------|--------|--------|
| Ibovespa (Benchmark) | -3,04% | -9,01% | -5,37% | -4,11% | 12,70% | 9,65% | - | - |
| BB FI AÇÕES | -1,21% | -0,49% | -5,83% | 2,11% | 30,70% | 72,60% | 10,50% | 19,82% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | -2,30% | -8,63% | -4,82% | -3,12% | 10,82% | -0,56% | 4,31% | 14,18% |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | 0,19% | -0,96% | -3,43% | 6,31% | 12,28% | 39,26% | 8,32% | 15,91% |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES | -2,54% | -9,95% | -5,87% | -4,56% | 10,35% | 5,33% | 4,26% | 13,63% |
| PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES | -5,07% | -11,50% | -8,39% | -5,95% | 3,85% | -4,02% | 7,53% | 19,64% |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES | -5,07% | -11,50% | -8,39% | -5,95% | 3,85% | -4,02% | 7,53% | 19,64% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | -2,32% | -6,76% | -6,29% | -0,55% | 15,12% | 13,46% | 7,67% | 15,63% |
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | -3,43% | -13,30% | -8,90% | -6,94% | 6,85% | 9,10% | 8,12% | 17,60% |

INSTITUTO MUNICIPAL DA PREVIDÊNCIA SOCIAL DE LADÁRIO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2024

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 7,32% | 25,07% | 12,29% | 28,62% | 37,90% | 58,29% | - | - |
| BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,26% | 18,59% | 6,42% | 22,19% | 31,61% | 43,37% | 4,50% | 13,600% |