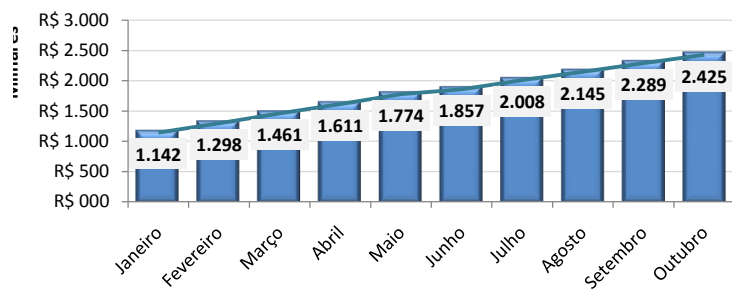


# INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE RIO BRANCO - CONTA ADMINISTRAÇÃO

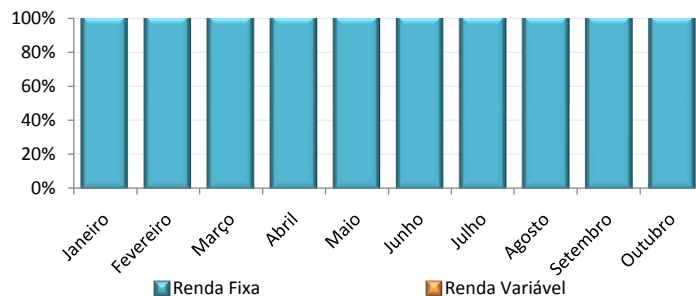


## Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos Outubro De 2014

**Evolução do Patrimônio no Ano**



**Distribuição por Segmento no Ano**



### Enquadramento Legal - Resolução CMN n.º 3.922/10

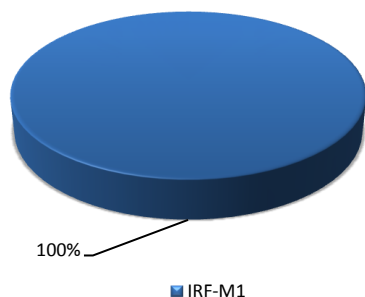
Enquadramento Legal - Resolução CMF nº 8/2014					Rentabilidade do Fundo			Risco	
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por fundo	% da Carteira	out-14	2014	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
b) Renda Fixa									
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b	100%	100,00%	0,82%	8,43%	10,07%	0,23%	0,49%
Total em Renda Fixa				100,00%					
b) Renda Variável									
Total em Renda Variável				0,00%					

\* As informações desses fundos (rentabilidade, VaR e volatilidade) foram extraídas do software Quantum Axis, calculado com base nos últimos doze meses.

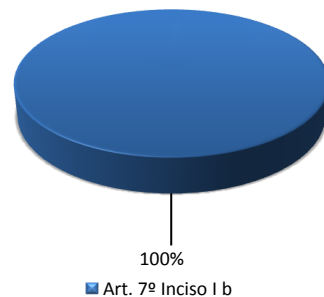
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

² Volatilidade: A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

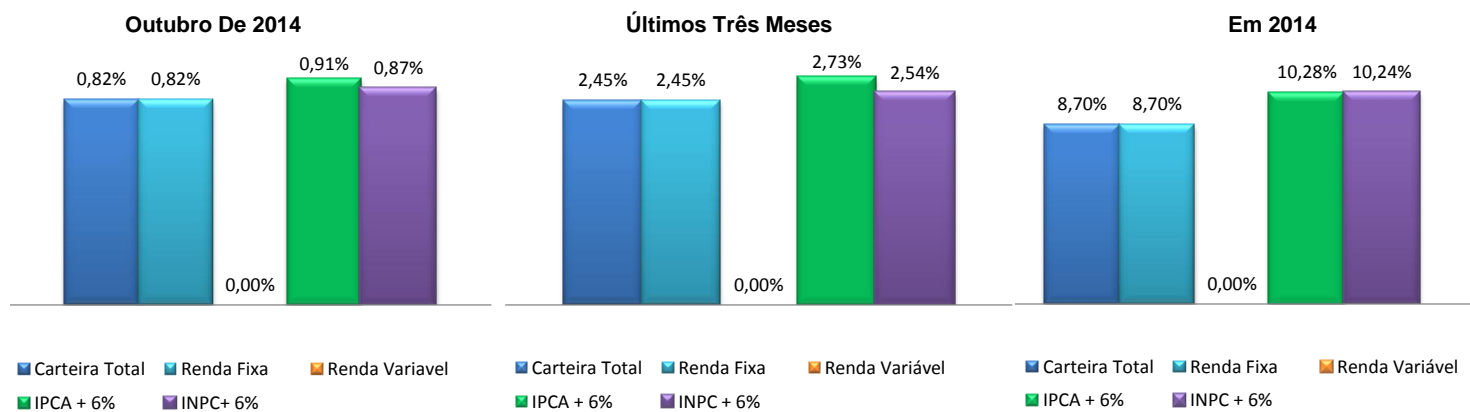
**Distribuição por Parâmetro de Rentabilidade**



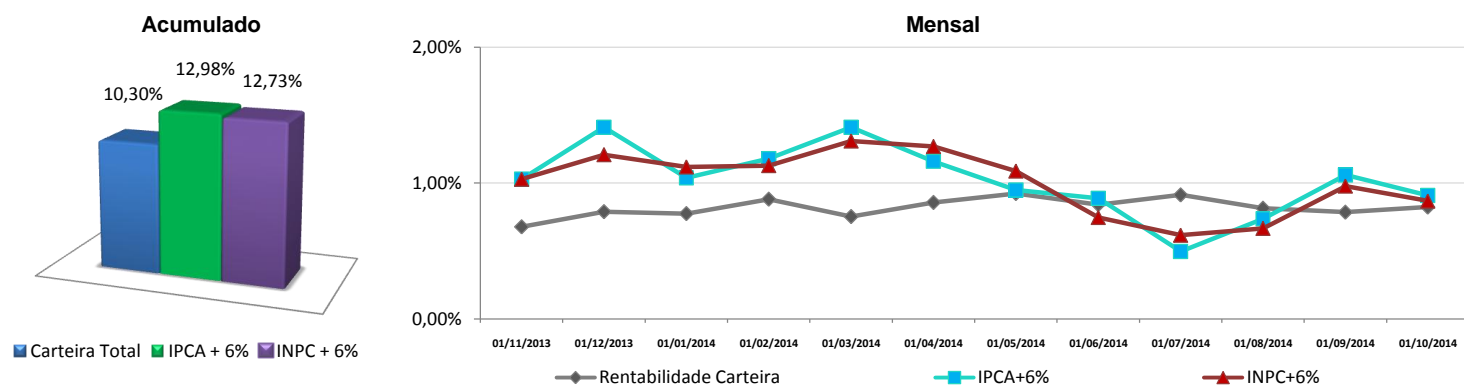
**Distribuição por Enquadramento Legal**



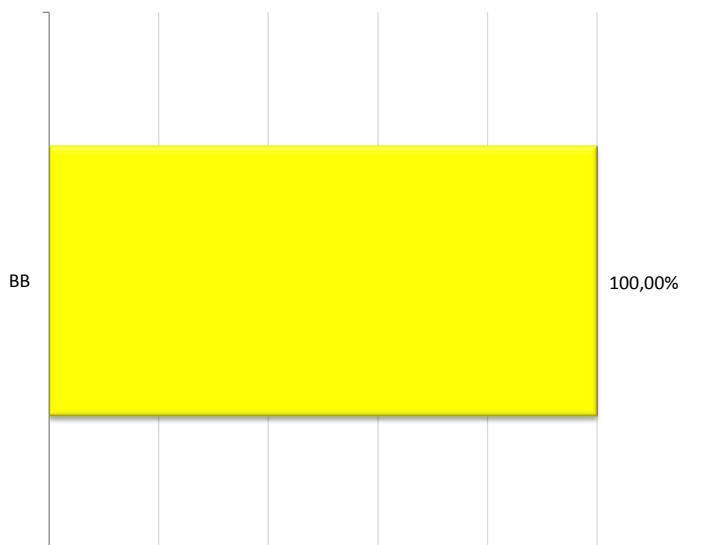
## Rentabilidade da Carteira Total comparada com as Carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Meta Atuarial



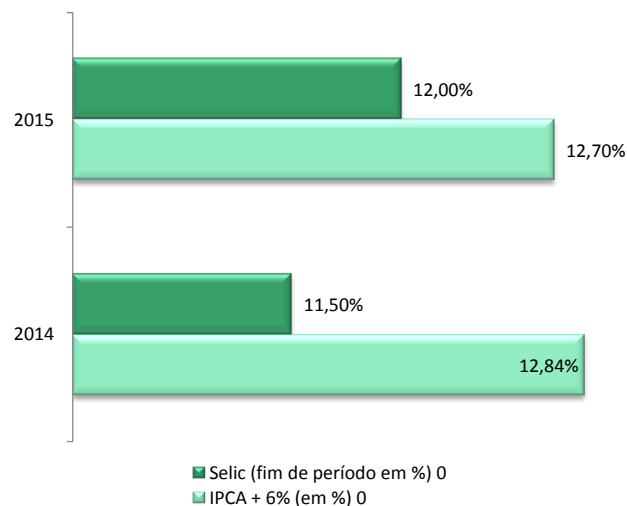
## Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial nos últimos doze meses



## Total por Instituição Financeira

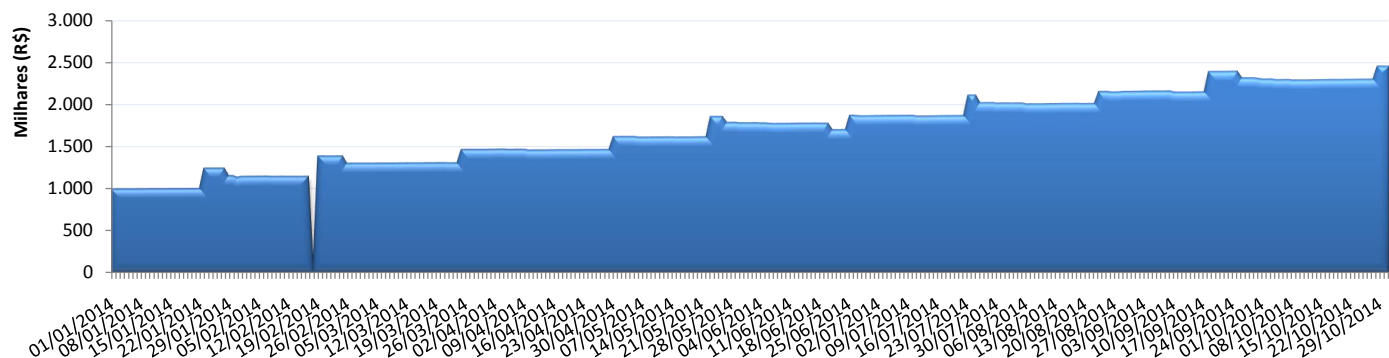


## Projeção de Indicadores de Mercado

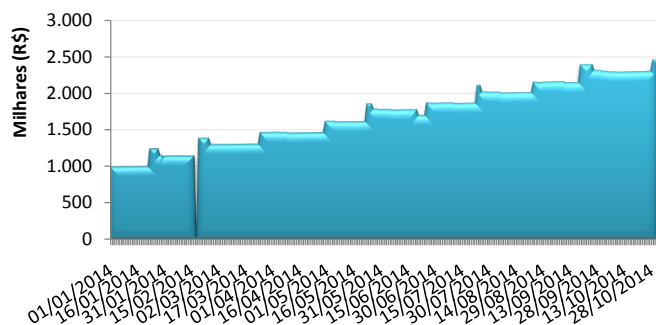


Fonte: Relatório Focus Banco Central - 07/11/2014

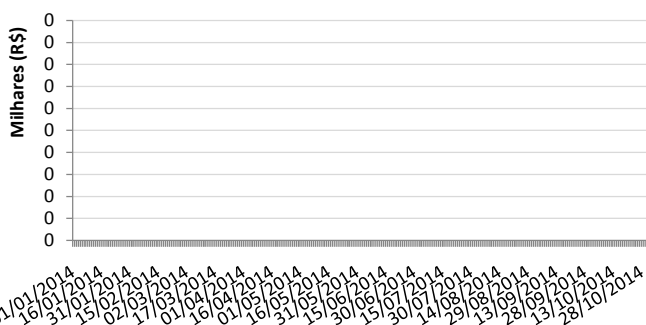
### Evolução do Patrimônio Líquido no Ano - (em valores diários)



### Evolução dos Investimentos em Renda Fixa no Ano



### Evolução dos Investimentos em Renda Variável no Ano



Retorno dos Indicadores					
INDICADORES	Rentabilidade em Outubro	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2014	Rentab. 12 Meses
CDI	0,94%	2,73%	5,44%	8,85%	10,48%
IBOVESPA	0,95%	-2,15%	5,81%	6,06%	0,69%
IBRX	0,95%	-1,82%	5,10%	5,65%	0,33%
ICON	5,95%	8,07%	16,41%	15,24%	14,33%
IDIV	-5,62%	-11,41%	-4,67%	-5,35%	-10,60%
IDKa IPCA 2 Anos	0,87%	2,08%	5,96%	10,39%	12,17%
IDKa IPCA 20 Anos	4,99%	6,00%	17,75%	24,16%	10,47%
IEE	-4,15%	-6,76%	2,34%	0,77%	-4,92%
IGC	3,22%	1,31%	7,97%	8,19%	4,15%
IMA Geral ex-C	1,43%	2,55%	6,89%	11,34%	10,99%
IMA-B	2,08%	3,22%	8,90%	14,32%	11,66%
IMA-B 5	0,94%	2,31%	5,86%	10,44%	11,73%
IMA-B 5+	2,73%	3,86%	11,02%	16,97%	11,43%
INPC+6%	0,87%	2,54%	5,07%	10,24%	12,73%
IPCA+6%	0,91%	2,73%	5,15%	10,28%	12,98%
IRF-M	1,14%	1,99%	6,00%	10,19%	10,63%
IRF-M 1	0,86%	2,54%	5,39%	8,72%	10,42%
IRF-M 1+	1,24%	1,64%	6,30%	10,96%	10,75%

### Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos

