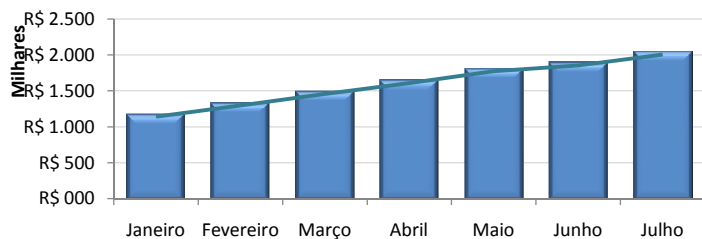




## INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE RIO BRANCO - CONTA ADMINISTRAÇÃO

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

**Evolução do Patrimônio no Ano**



**Distribuição por Segmento no Ano**



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

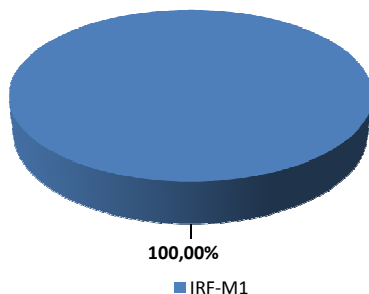
Enquadramento Legal - Resolução CMF n.º 15/2014					Rentabilidade do Fundo			Risco	
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por % da Carteira fundo		Jul-14	2014	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
b) Renda Fixa									
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b	100%	100,00%	0,91%	5,84%	9,50%	0,08%	0,16%
Total em Renda Fixa				100,00%					

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

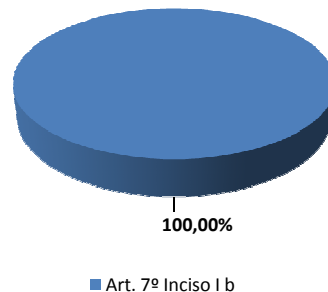
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR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

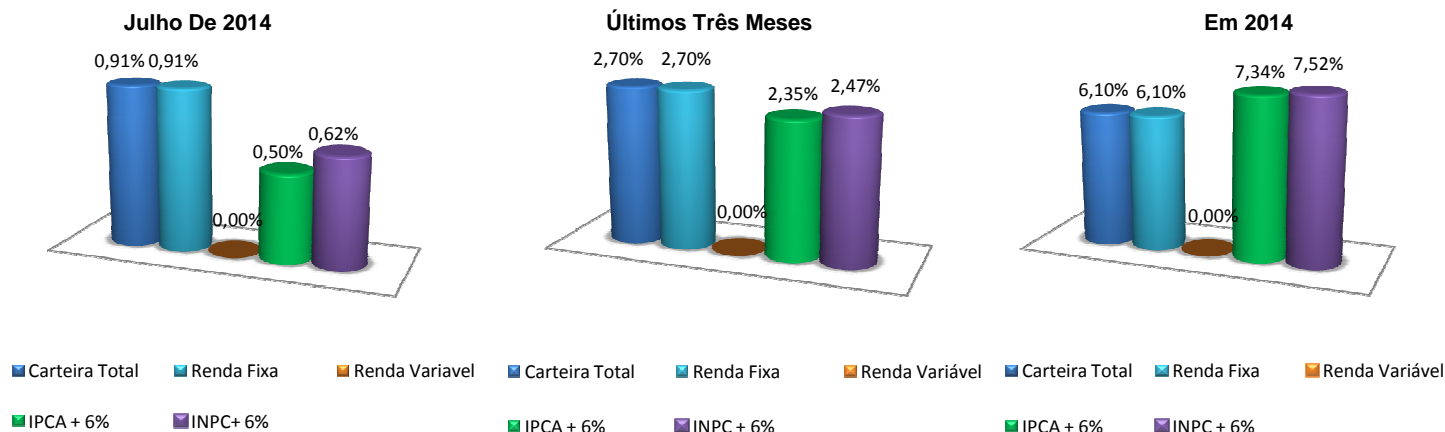
**Distribuição por Parâmetro de Rentabilidade**



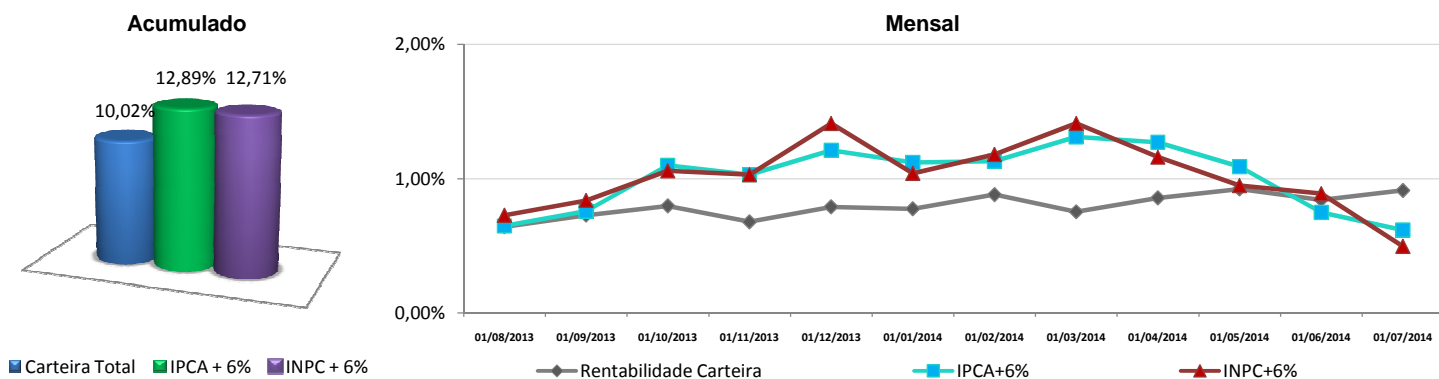
**Distribuição por Enquadramento Legal**



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



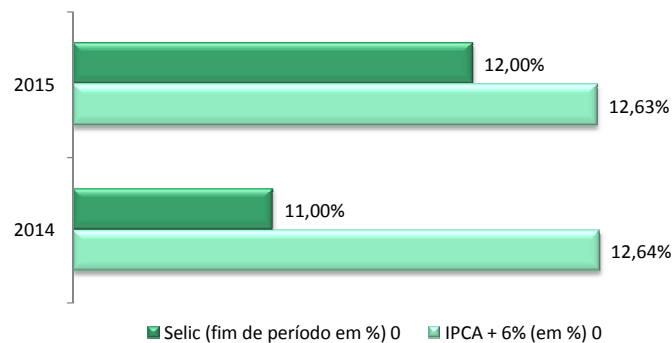
## Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial nos últimos doze meses



## Total por Instituição Financeira

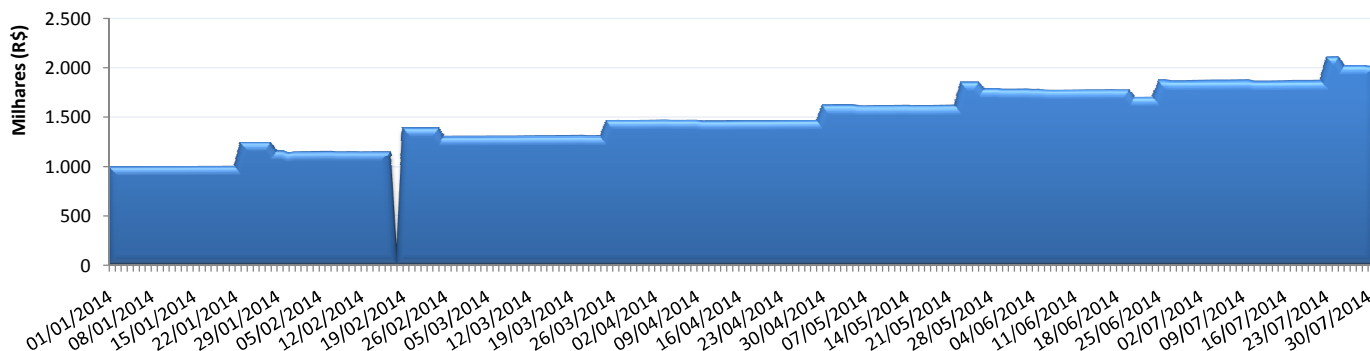


## Projeção de Indicadores de Mercado

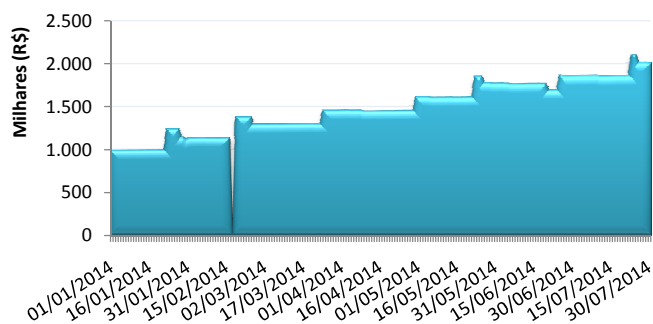


Relatório Focus Bacen - 08/08/2014

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



### Evolução dos Investimentos em Renda Fixa no Ano



### Retorno dos Indicadores

INDICADORES	Rentabilidade em Julho	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2014	Rentab. 12 Meses
CDI	0,94%	2,64%	5,08%	5,96%	9,93%
IBOVESPA	5,00%	8,14%	17,19%	8,39%	15,75%
IBRX	4,46%	7,04%	17,15%	7,60%	15,14%
ICON	0,99%	7,72%	16,41%	6,64%	9,43%
IDIV	5,94%	7,60%	15,20%	6,84%	14,87%
IDkA IPCA 2 Anos	0,93%	3,80%	9,26%	8,14%	11,70%
IDkA IPCA 20 Anos	2,53%	11,08%	26,70%	17,14%	-2,35%
IEE	0,84%	9,77%	12,54%	8,07%	9,41%
IGC	2,43%	6,57%	15,95%	6,79%	13,22%
IMA Geral ex-C	1,09%	4,23%	9,43%	8,57%	8,79%
IMA-B	1,13%	5,50%	13,65%	10,75%	6,72%
IMA-B 5	0,86%	3,47%	8,81%	7,95%	10,58%
IMA-B 5+	1,31%	6,89%	17,09%	12,62%	4,17%
INPC+6%	0,62%	2,47%	6,32%	7,52%	12,71%
IPCA+6%	0,50%	2,35%	6,24%	7,34%	12,89%
IRF-M	1,13%	3,94%	8,24%	8,04%	9,75%
IRF-M 1	0,94%	2,79%	5,61%	6,03%	9,84%
IRF-M 1+	1,24%	4,58%	9,74%	9,17%	9,79%

### Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos

