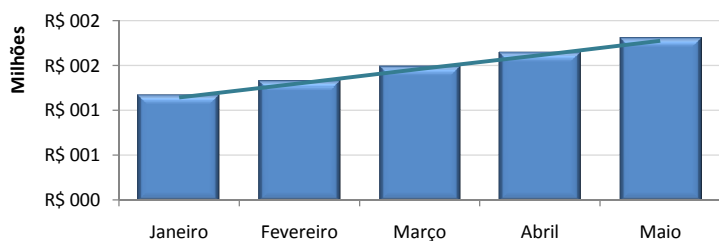




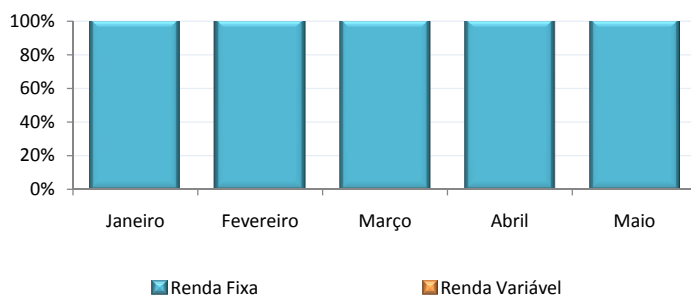
INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE RIO BRANCO - CONTA ADMINISTRAÇÃO

Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos Maio De 2014

Evolução do Patrimônio no Ano



Distribuição por Segmento no Ano



Enquadramento Legal - Resolução CMN n.º 3.922/10

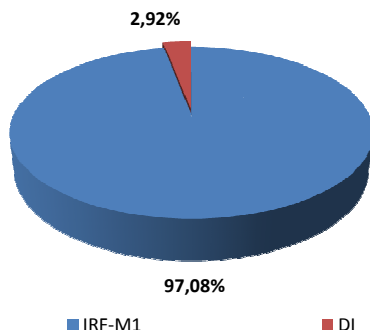
Enquadramento Legal: Resolução CMF nº 022/12					Rentabilidade do Fundo			Risco	
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por % da Carteira fundo		mai-14	2014	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
b) Renda Fixa									
DI	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	Art. 7º Inciso IV	20%	2,92%	0,89%	4,20%	9,43%	0,03%	0,03%
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b	100%	97,08%	0,92%	4,00%	8,96%	0,15%	0,15%
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.

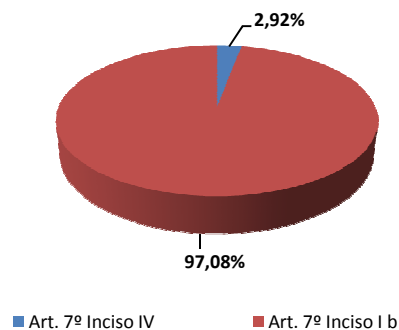
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR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

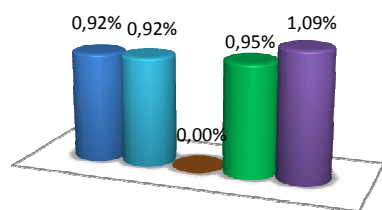


Distribuição por Enquadramento Legal

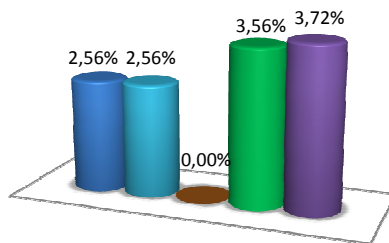


Rentabilidade da Carteira Total comparada com as Carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Meta Atuarial

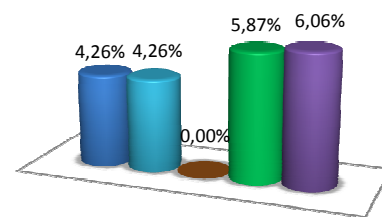
Maio De 2014



Últimos Três Meses



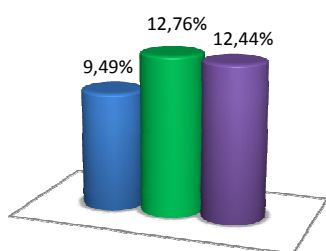
Em 2014



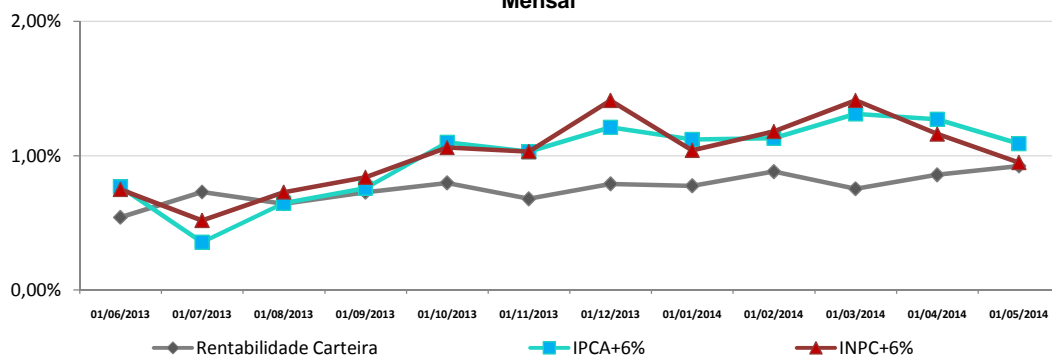
■ Carteira Total ■ Renda Fixa ■ Renda Variável ■ Carteira Total ■ Renda Fixa ■ Renda Variável ■ Carteira Total ■ Renda Fixa ■ Renda Variável
■ IPCA + 6% ■ INPC + 6% ■ IPCA + 6% ■ INPC + 6% ■ IPCA + 6% ■ INPC + 6%

Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial nos últimos doze meses

Acumulado

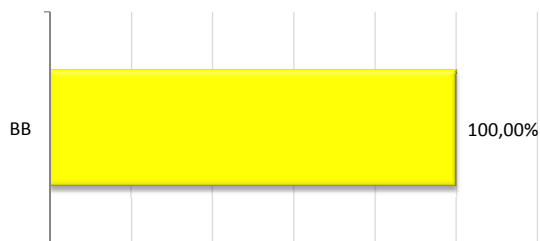


Mensal

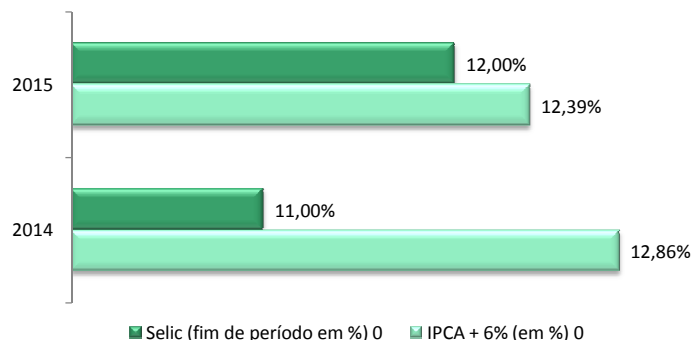


■ Carteira Total ■ IPCA + 6% ■ INPC + 6%

Total por Instituição Financeira

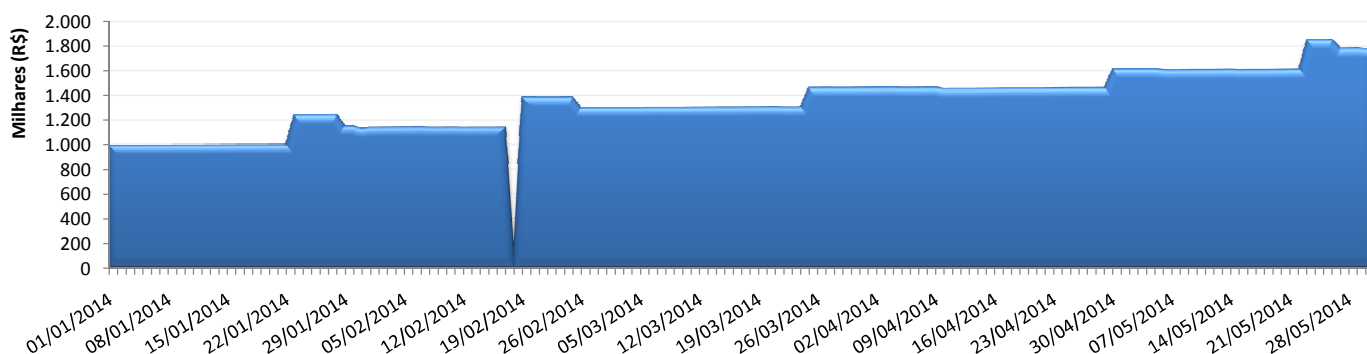


Projeção de Indicadores de Mercado

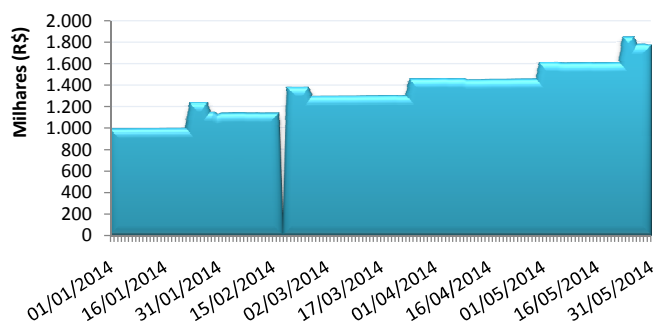


Relatório Focus Bacen - 06/06/2014

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



Evolução dos Investimentos em Renda Fixa no Ano



Retorno dos Indicadores

INDICADORES	Rentabilidade em Maio	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2014	Rentab. 12 Meses
CDI	0,86%	2,45%	4,94%	4,12%	9,43%
IBOVESPA	-0,75%	8,80%	-2,37%	-0,52%	-4,24%
IBRX	-1,12%	8,57%	-3,65%	-0,60%	-1,59%
ICON	2,07%	8,62%	-0,70%	1,04%	-0,58%
IDIV	-2,87%	6,35%	-5,61%	-3,55%	-1,68%
IDkA IPCA 2 Anos	1,45%	3,69%	7,16%	5,70%	9,65%
IDkA IPCA 20 Anos	12,02%	18,88%	20,43%	18,13%	-5,75%
IEE	1,87%	14,19%	-2,59%	0,30%	-7,70%
IGC	-0,31%	8,09%	-2,29%	-0,10%	-1,37%
IMA Geral ex-C	2,51%	4,87%	7,82%	6,78%	6,87%
IMA-B	4,27%	7,55%	10,88%	9,45%	3,85%
IMA-B 5	1,47%	3,73%	7,10%	5,86%	8,69%
IMA-B 5+	6,19%	10,16%	13,45%	11,88%	0,90%
INPC+6%	1,09%	3,72%	7,35%	6,06%	12,44%
IPCA+6%	0,95%	3,56%	7,37%	5,87%	12,76%
IRF-M	1,84%	3,78%	6,74%	5,86%	7,90%
IRF-M 1	0,95%	2,64%	4,99%	4,13%	9,31%
IRF-M 1+	2,33%	4,40%	7,72%	6,82%	7,32%

Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos

