



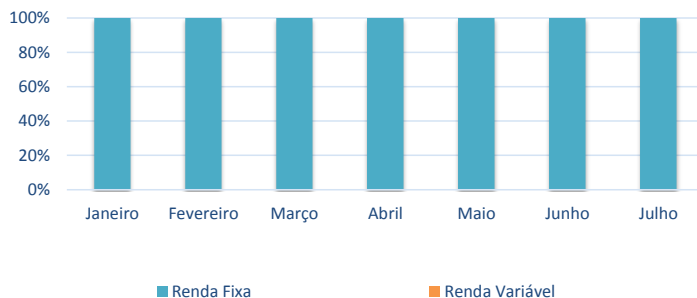
## INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE RIO BRANCO - CONTA ADMINISTRAÇÃO

### Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos Julho De 2015

**Evolução do Patrimônio no Ano**



**Distribuição por Segmento no Ano**



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

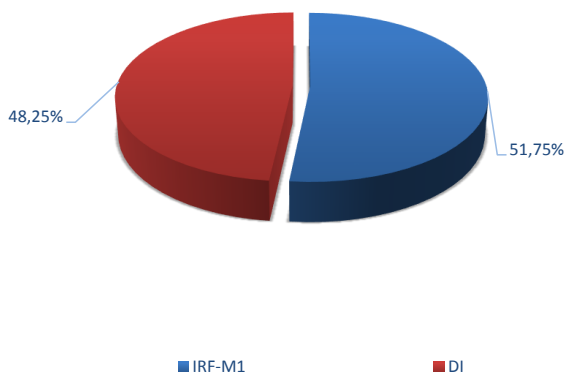
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por fundo	% da Carteira	jul-15	2015	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
a) Renda Fixa									
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b		100%	1,25%	6,71%	11,13%	0,24%	0,50%
DI	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	Art. 7º Inciso IV a		20%	1,20%	7,33%	12,35%	0,02%	0,04%
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.

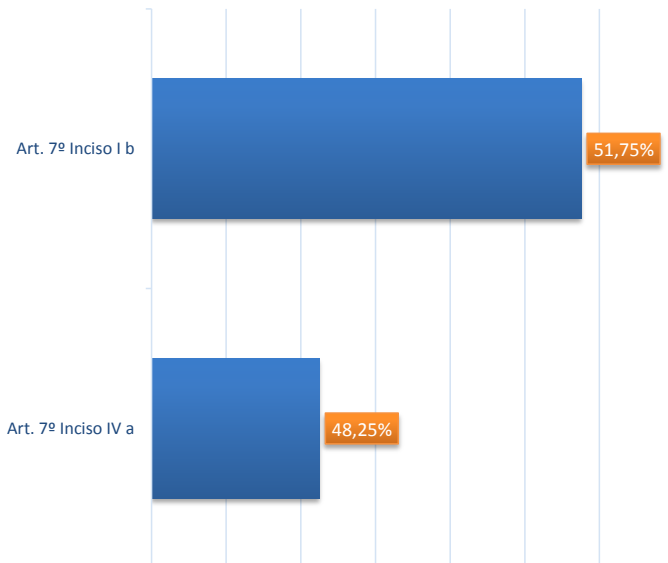
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR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

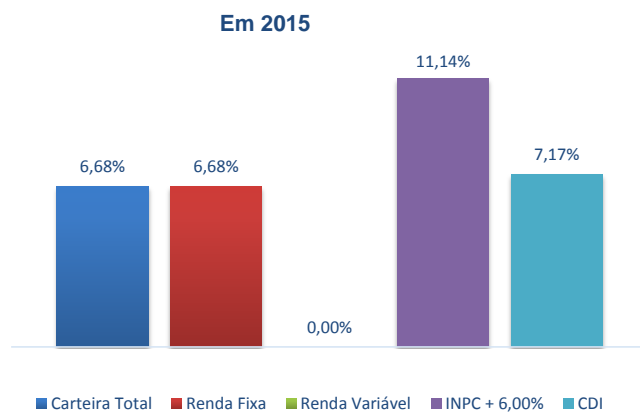
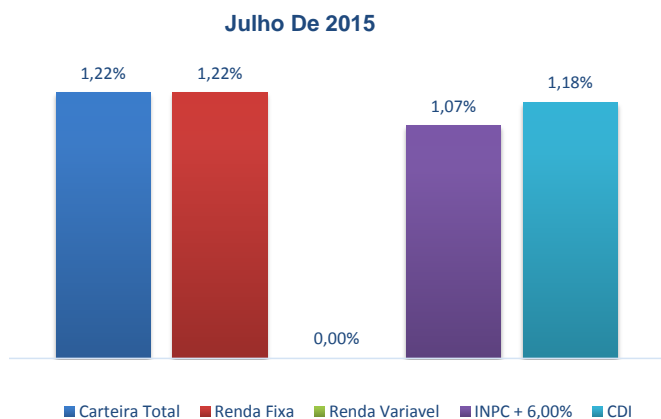
**Distribuição por Parâmetro de Rentabilidade**



**Distribuição por Enquadramento Legal**

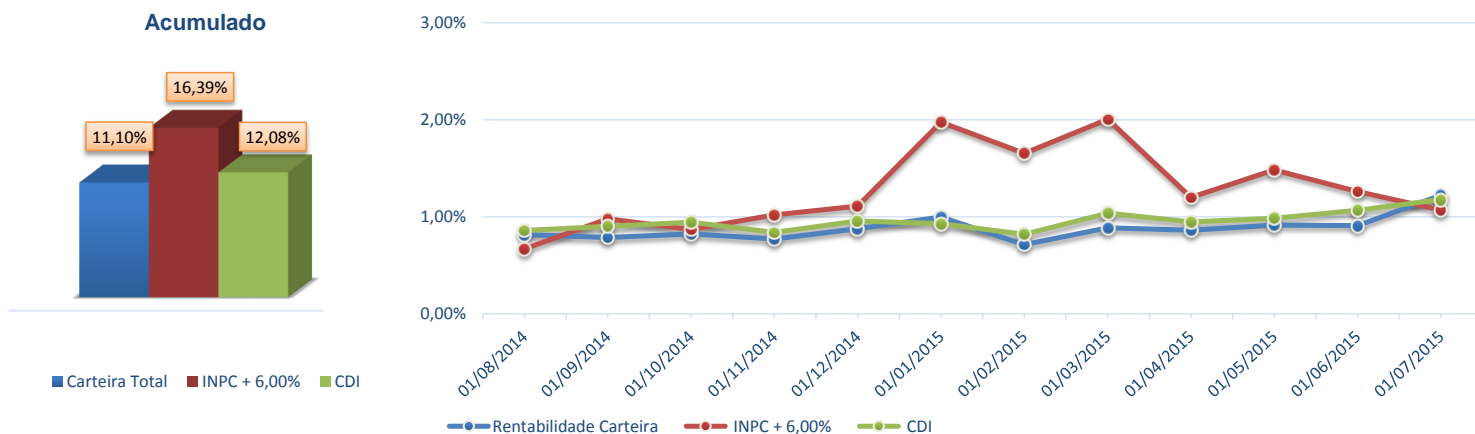


## Rentabilidade da Carteira Total comparada com as Carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Meta Atuarial

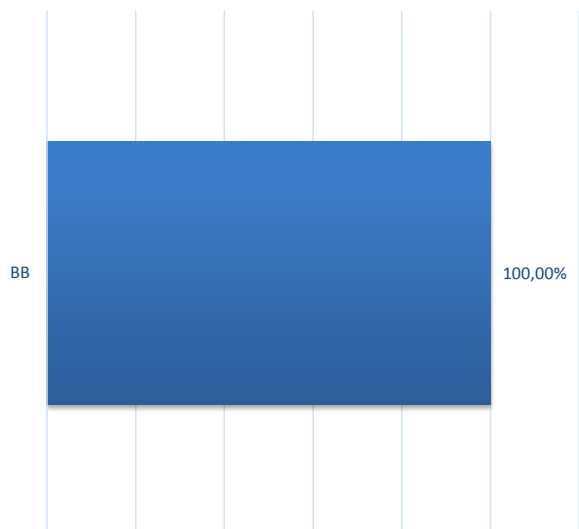


## Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial nos últimos 12 meses

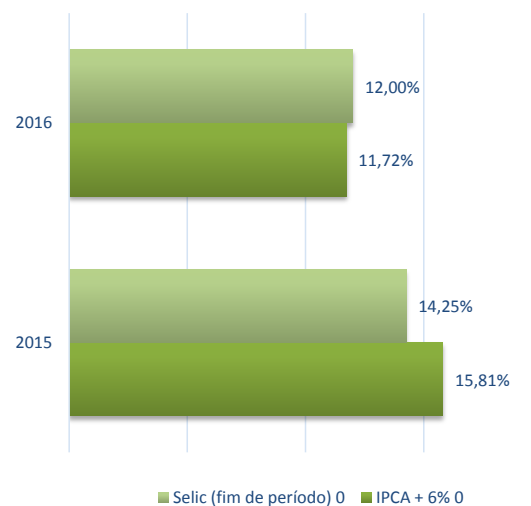
### Acumulado



## Total por Instituição Financeira

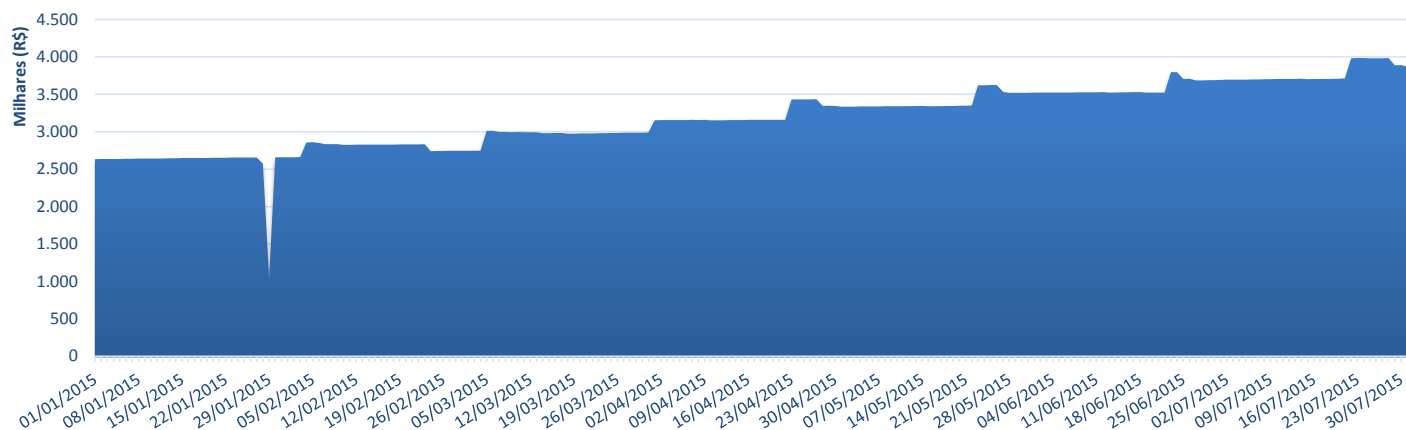


## Projeção de Indicadores de Mercado



Fonte: Relatório Focus Banco Central

### 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 Julho	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2015	Rentab. 12 Meses
CDI	1,18%	3,26%	6,18%	7,17%	12,08%
IBOVESPA	-4,17%	-9,54%	8,44%	1,71%	-8,89%
IBRX	-3,44%	-8,03%	9,16%	2,74%	-7,17%
ICON	-0,74%	-1,22%	8,57%	5,72%	10,65%
IDIV	-3,46%	-12,43%	3,43%	-8,13%	-29,52%
IDkA IPCA 2 Anos	1,86%	5,07%	7,90%	10,02%	13,41%
IDkA IPCA 20 Anos	-6,74%	-4,09%	-0,12%	4,58%	8,78%
IEE	-2,14%	0,52%	20,17%	9,00%	4,36%
IGC	-2,33%	-5,88%	8,40%	1,53%	-2,73%
IMA Geral ex-C	0,58%	2,72%	4,92%	7,11%	10,86%
IMA-B	-0,73%	1,55%	4,30%	7,55%	11,23%
IMA-B 5	1,78%	4,32%	7,17%	9,37%	13,11%
IMA-B 5+	-1,80%	0,55%	3,24%	7,07%	10,86%
INPC + 6,00%	1,07%	3,86%	8,98%	11,14%	16,39%
INPC	0,58%	2,36%	5,86%	7,42%	9,81%
IRF-M	1,23%	3,21%	4,61%	6,48%	9,79%
IRF-M 1	1,28%	3,20%	5,82%	6,95%	11,54%
IRF-M 1+	1,21%	3,23%	3,95%	6,22%	8,85%

### Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos

