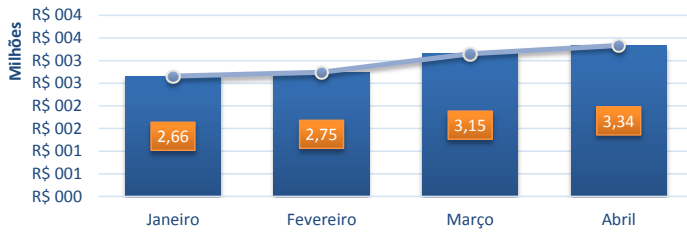




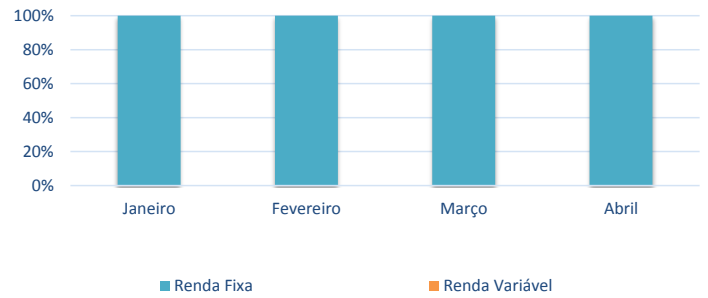
# INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE RIO BRANCO - CONTA ADMINISTRAÇÃO

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

**Evolução do Patrimônio no Ano**



**Distribuição por Segmento no Ano**



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

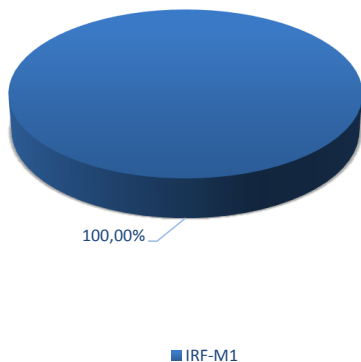
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por fundo	% da Carteira	abr-15	2015	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
b) Renda Fixa									
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b	100%	100,00000%	0,86%	3,50%	10,70%	0,86%	0,55%
Total em Renda Fixa				100,00%					
b) Renda 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.

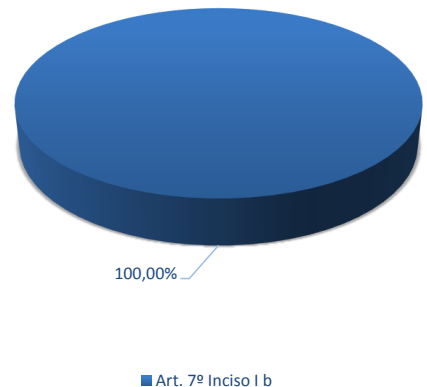
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR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

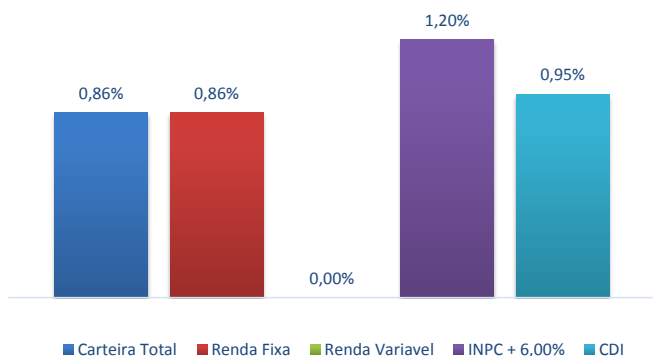


**Distribuição por Enquadramento Legal**

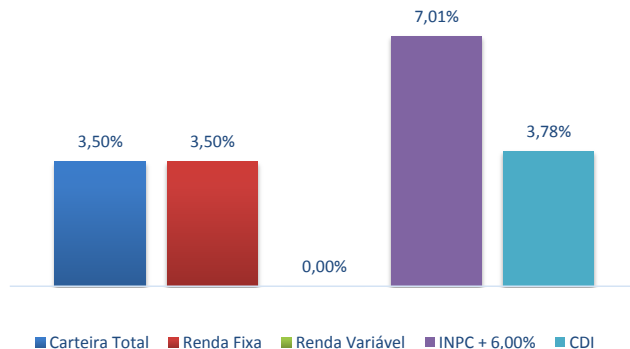


## Rentabilidade da Carteira Total comparada com as Carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Meta Atuarial

Abril De 2015

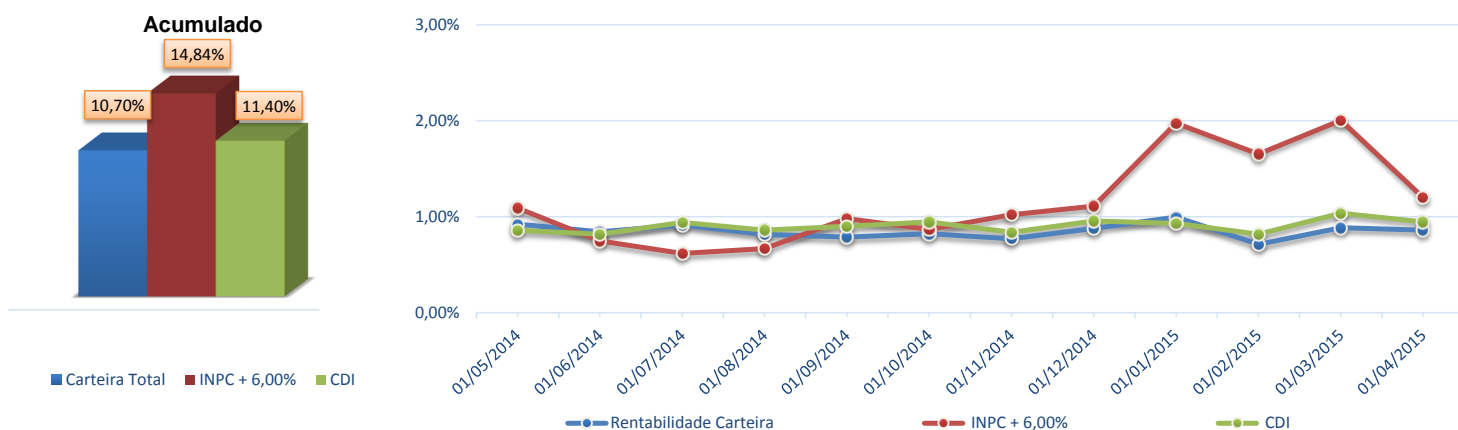


Em 2015

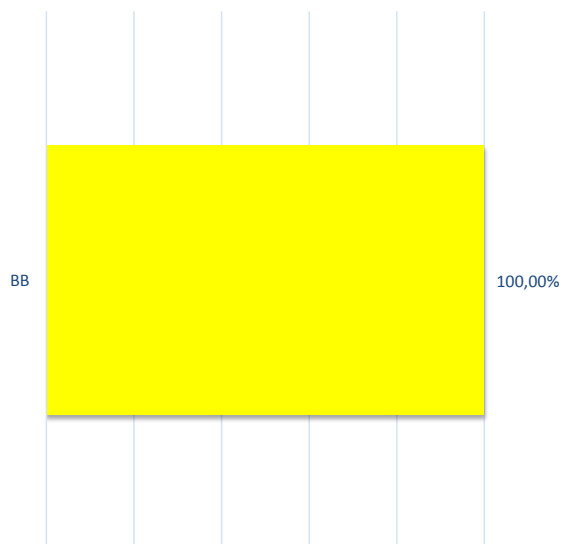


## Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial no ano

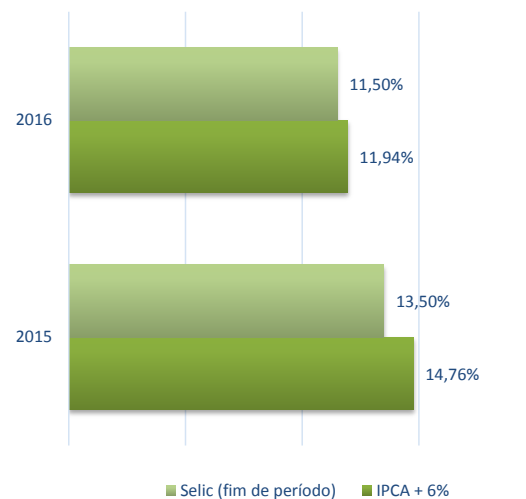
Acumulado



## Total por Instituição Financeira

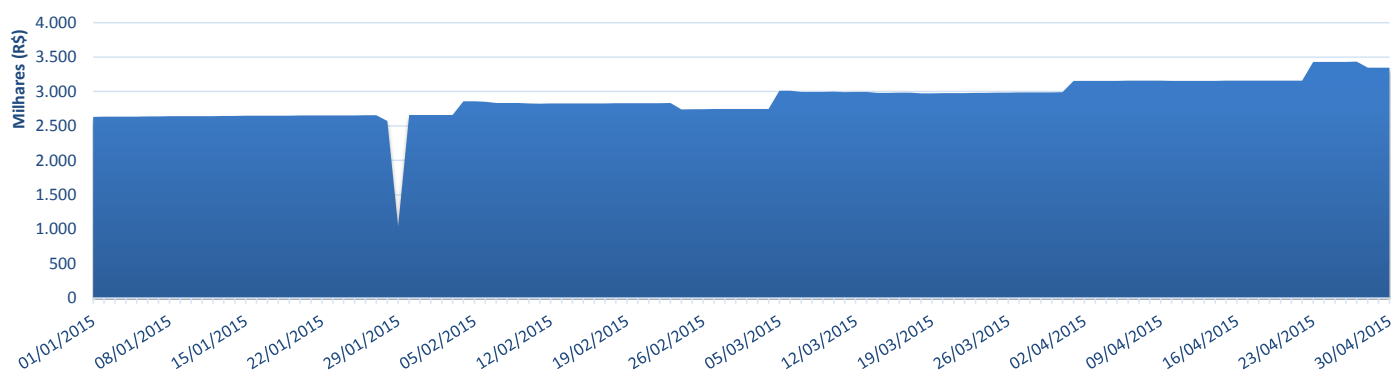


## Projeção de Indicadores de Mercado

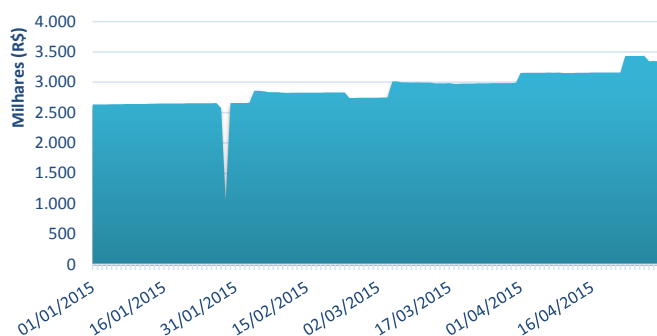


Fonte: Relatório Focus Banco Central

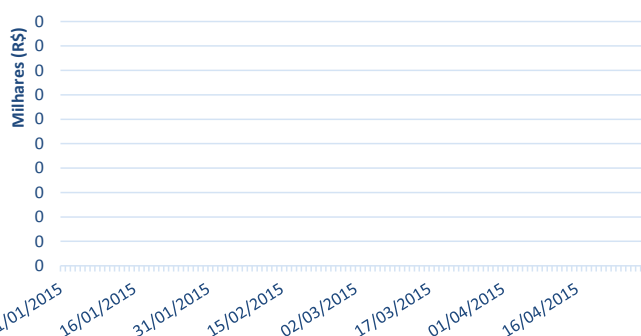
### Evolução do Patrimônio Líquido no Ano - (em valores diários)



### Evolução dos Investimentos em Renda Fixa no Ano



### Evolução dos Investimentos em Renda Variável no Ano



### **Retorno dos Indicadores**

INDICADORES	Rentabilidade em Abril	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2015	Rentab. 12 Meses
CDI	0,95%	2,83%	5,65%	3,78%	11,40%
IBOVESPA	9,93%	19,87%	2,93%	12,44%	8,92%
IBRX	9,12%	18,69%	2,80%	11,71%	8,04%
ICON	5,26%	9,91%	3,66%	7,03%	20,67%
IDIV	11,84%	18,11%	-9,15%	4,91%	-13,40%
IDKa IPCA 2 Anos	0,37%	2,70%	5,74%	4,71%	12,04%
IDKa IPCA 20 Anos	8,00%	4,14%	7,00%	9,04%	25,99%
IEE	7,09%	19,56%	11,35%	8,44%	13,96%
IGC	6,32%	15,17%	2,01%	7,87%	10,14%
IMA Geral ex-C	1,55%	2,14%	5,23%	4,27%	12,49%
IMA-B	2,44%	2,70%	6,11%	5,91%	15,56%
IMA-B 5	0,46%	2,73%	5,98%	4,84%	12,19%
IMA-B 5+	3,55%	2,67%	6,15%	6,48%	17,85%
INPC + 6,00%	1,20%	4,93%	9,30%	7,01%	14,84%
INPC	0,71%	3,42%	6,16%	4,95%	8,34%
IRF-M	1,09%	1,35%	4,29%	3,16%	10,56%
IRF-M 1	0,84%	2,53%	5,40%	3,63%	11,08%
IRF-M 1+	1,23%	0,70%	3,75%	2,90%	10,28%

**Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos**

