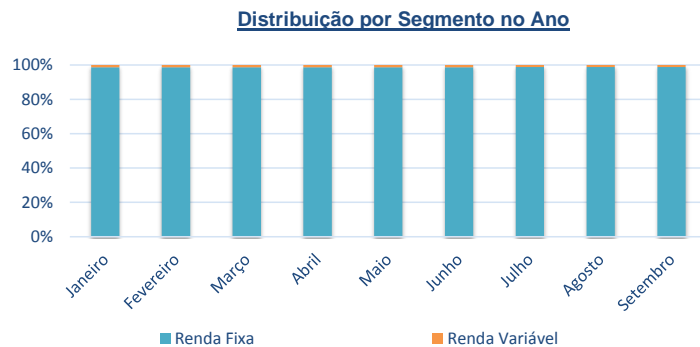
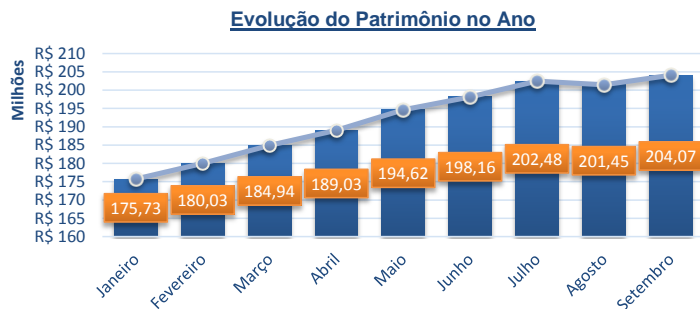




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE RIO BRANCO - FUNDO PREVIDENCIÁRIO - AC

Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos Setembro De 2015



Enquadramento Legal - Resolução CMN n.º 3.922/10

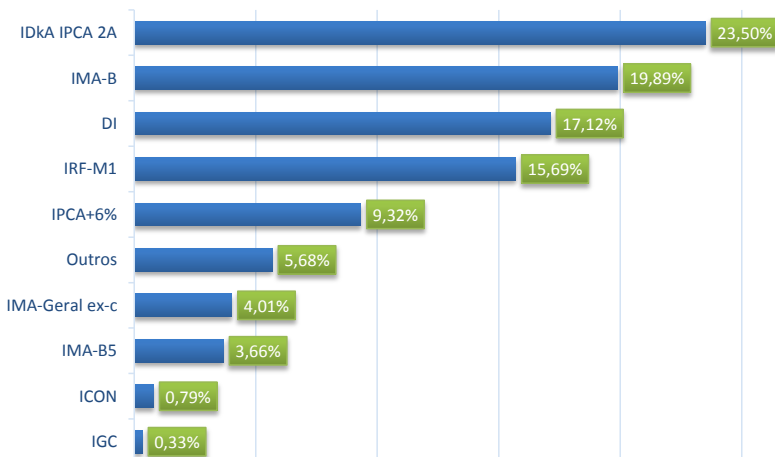
Enquadramento Legal - Resoluções CMFV - 01/2017 e 02/2018					Rentabilidade do fundo			Risco	
Tipo Fundo	Fundo de Investimento	Enquadramento	Limites Legais por fundo	% da Carteira	set-15	2015	12 Meses	V@R¹	Volatilidade²
a) Renda Fixa									
IPCA+6%	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRED PRIV	Art. 7º Inciso VII b	5%	2,90274%	-0,24%	6,44%	8,78%	6,74%	14,20%
IDKa IPCA 2A	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Art. 7º Inciso I b	100%	23,50267%	0,88%	9,67%	11,76%	2,68%	5,65%
IRF-M1	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TP FIC	Art. 7º Inciso I b	100%	11,46856%	0,89%	8,73%	11,44%	0,44%	0,92%
IMA-Geral ex-c	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	Art. 7º Inciso I b	100%	4,00915%	-0,40%	5,34%	7,67%	4,84%	10,19%
DI	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	Art. 7º Inciso IV a	20%	15,18297%	1,12%	9,74%	12,86%	0,03%	0,06%
IMA-B5	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5 LP FIC	Art. 7º Inciso III a	20%	3,66427%	0,74%	9,29%	11,45%	3,33%	7,01%
IPCA+6%	BB RPPS I FI RF IPCA CRED PRIV	Art. 7º Inciso VII b	5%	0,81292%	0,94%	11,50%	14,54%	0,75%	1,58%
IPCA+6%	BB TP IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	Art. 7º Inciso IV a	20%	5,60195%	0,87%	12,57%	16,22%		
IMA-B	BB TP IX FI RF PREVIDENCIÁRIO	Art. 7º Inciso I b	100%	14,94839%					
IMA-B	BB TP VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	Art. 7º Inciso I b	100%	4,94652%	0,78%	4,92%	4,92%	3,20%	6,73%
Outros	BB TP VIII FI RF PREVIDENCIÁRIO	Art. 7º Inciso IV a	20%	5,67710%	-0,28%	6,33%	8,31%	2,80%	5,89%
DI	CAIXA BRASIL FI REFEREN DI LP	Art. 7º Inciso IV a	20%	1,93827%	1,12%	9,64%	12,69%	0,02%	0,04%
IRF-M1	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	Art. 7º Inciso I b	100%	4,22471%	0,95%	8,89%	11,63%	0,37%	0,77%
Total em Renda Fixa				98,88%					
b) Renda Variável									
ICON	BB AÇÕES CONSUMO FIC	Art. 8º Inciso III	15%	0,78978%	-0,06%	-1,11%	1,08%	7,60%	16,00%
IGC	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Art. 8º Inciso III	15%	0,33002%	-1,82%	-8,68%	-11,01%	10,43%	21,97%
Total em Renda Variável				1,12%					

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

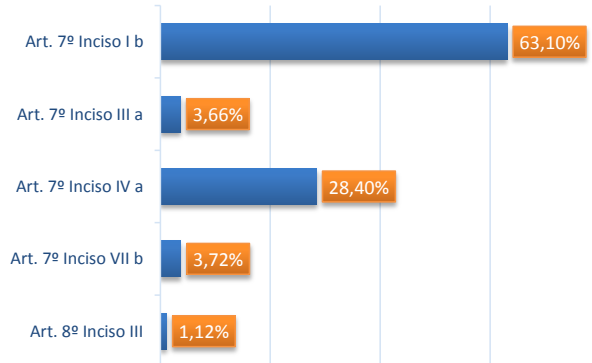
¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR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

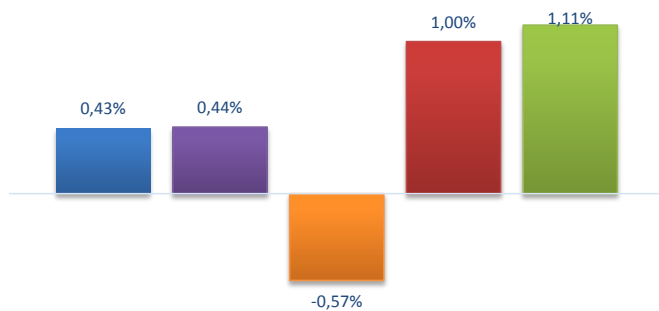


Distribuição por Enquadramento Legal



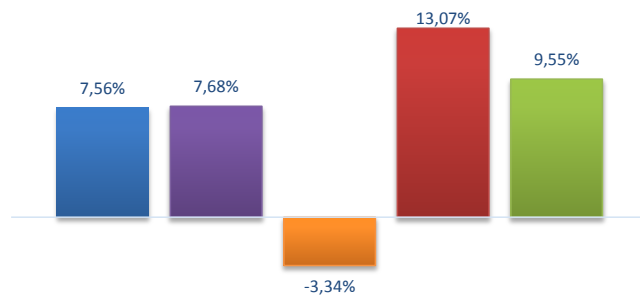
Rentabilidade da Carteira Total comparada com as Carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Meta Atuarial

Setembro De 2015



■ Carteira Total ■ Renda Fixa ■ Renda Variável ■ INPC + 6,00% ■ CDI

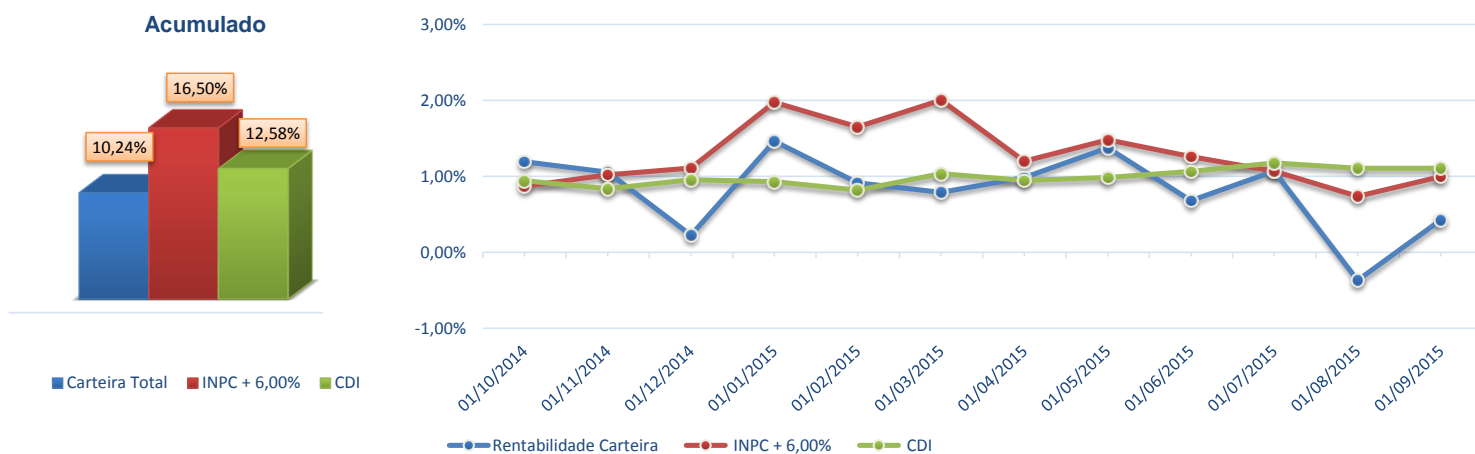
Em 2015



■ Carteira Total ■ Renda Fixa ■ Renda Variável ■ INPC + 6,00% ■ CDI

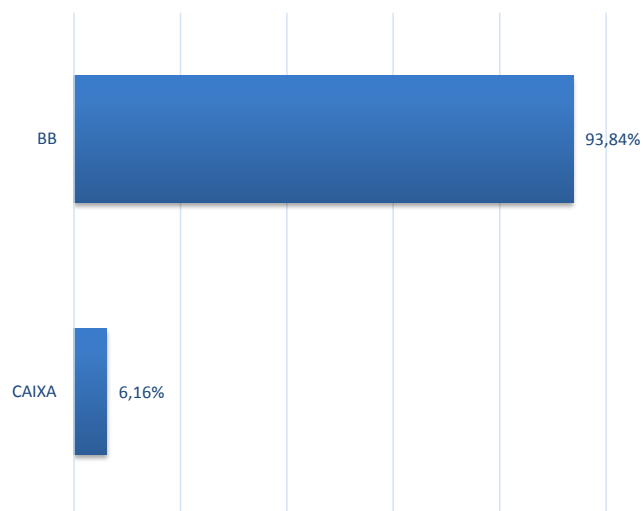
Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial nos últimos 12 meses

Acumulado

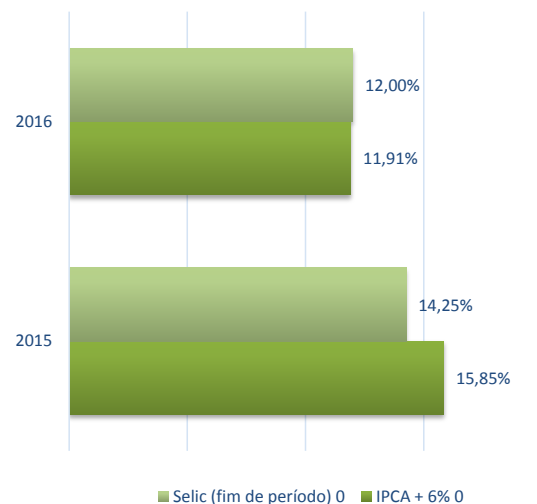


■ Carteira Total ■ INPC + 6,00% ■ CDI

Total por Instituição Financeira

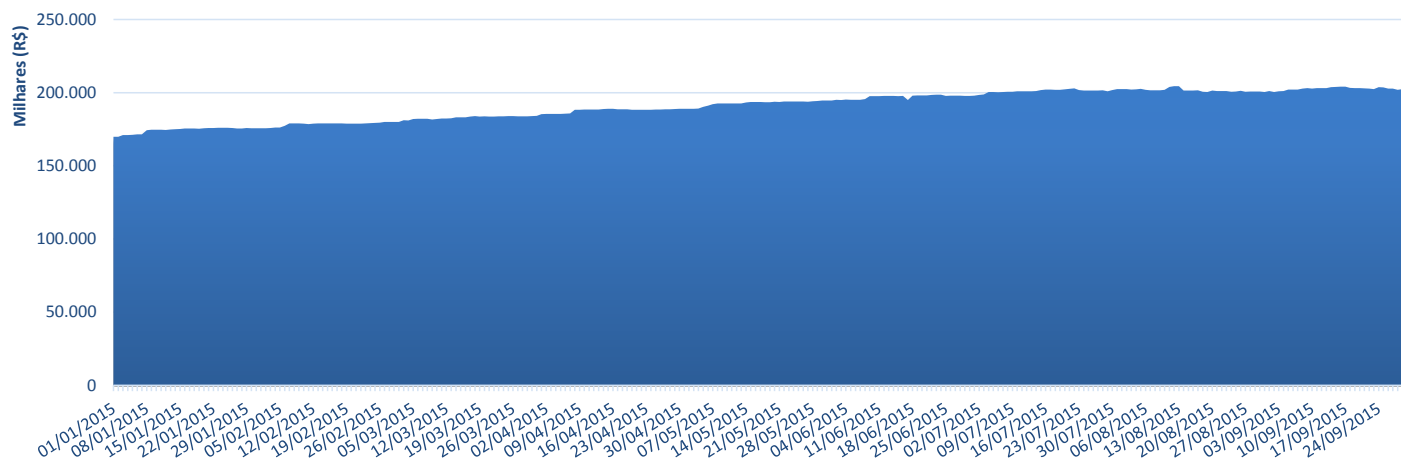


Projeção de Indicadores de Mercado

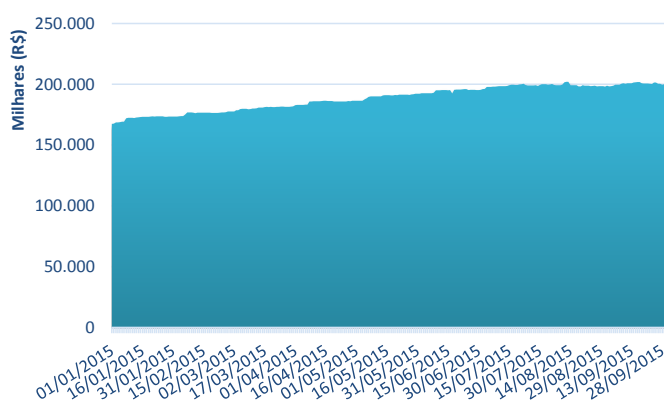


Fonte: Relatório Focus Banco Central

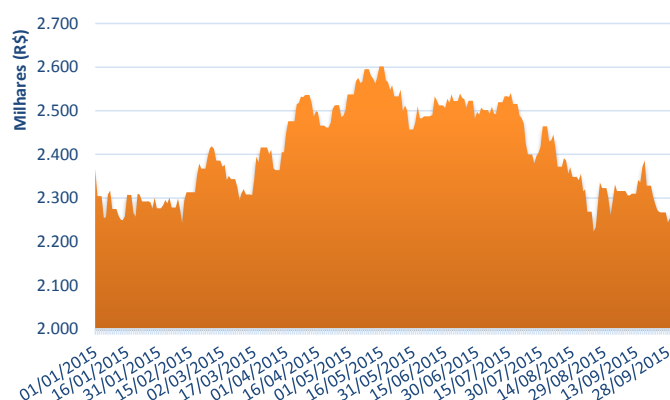
Evolução do Patrimônio Líquido no Ano - (em valores diários)



Evolução dos Investimentos em Renda Fixa no Ano



Evolução dos Investimentos em Renda Variável no Ano



Retorno dos Indicadores					
INDICADORES	Rentabilidade em Setembro	Rentab Trimestre	Rentab. Semestre	Rentabilidade em 2015	Rentab. 12 Meses
CDI	1,11%	3,43%	6,56%	9,55%	12,58%
IBOVESPA	-3,36%	-15,11%	-11,91%	-9,89%	-16,73%
IBRX	-3,11%	-14,16%	-10,78%	-8,66%	-15,15%
ICON	0,19%	-6,53%	-2,10%	-0,45%	2,15%
IDIV	-6,18%	-19,47%	-18,30%	-23,36%	-37,36%
IDkA IPCA 2 Anos	0,88%	2,48%	6,10%	10,69%	12,75%
IDkA IPCA 20 Anos	-4,66%	-18,87%	-9,89%	-9,01%	-6,26%
IEE	-0,25%	-14,80%	-6,29%	-5,10%	-6,60%
IGC	-1,81%	-12,08%	-9,92%	-8,61%	-10,79%
IMA Geral ex-C	-0,40%	-0,93%	2,75%	5,50%	8,00%
IMA-B	-0,68%	-4,48%	0,10%	3,49%	5,85%
IMA-B 5	0,79%	2,10%	5,13%	9,72%	11,95%
IMA-B 5+	-1,63%	-7,83%	-2,27%	0,49%	2,91%
INPC + 6,00%	1,00%	2,83%	6,94%	13,07%	16,50%
INPC	0,51%	1,35%	3,87%	8,24%	9,90%
IRF-M	-0,94%	-0,57%	2,49%	4,59%	6,94%
IRF-M 1	0,96%	3,30%	6,15%	9,08%	11,89%
IRF-M 1+	-2,29%	-3,22%	-0,07%	1,57%	3,68%

Evolução da Carteira por Distribuição de Produtos

