

# FUNPREI

**RESULTADOS - 2015**

## PANORAMA DOS INVESTIMENTOS

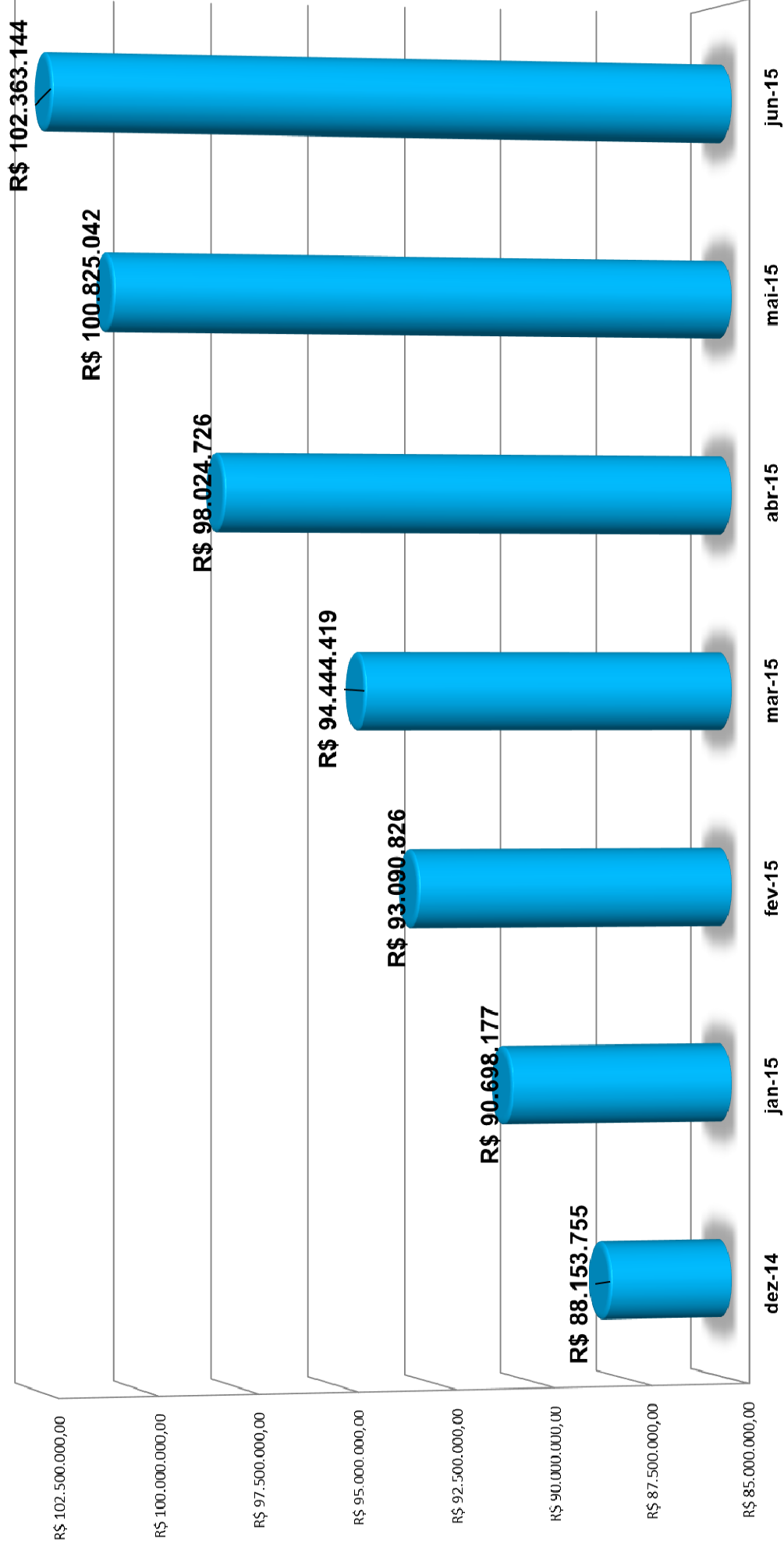
RESULTADOS - MENSAL

RESULTADOS - CONSOLIDADO

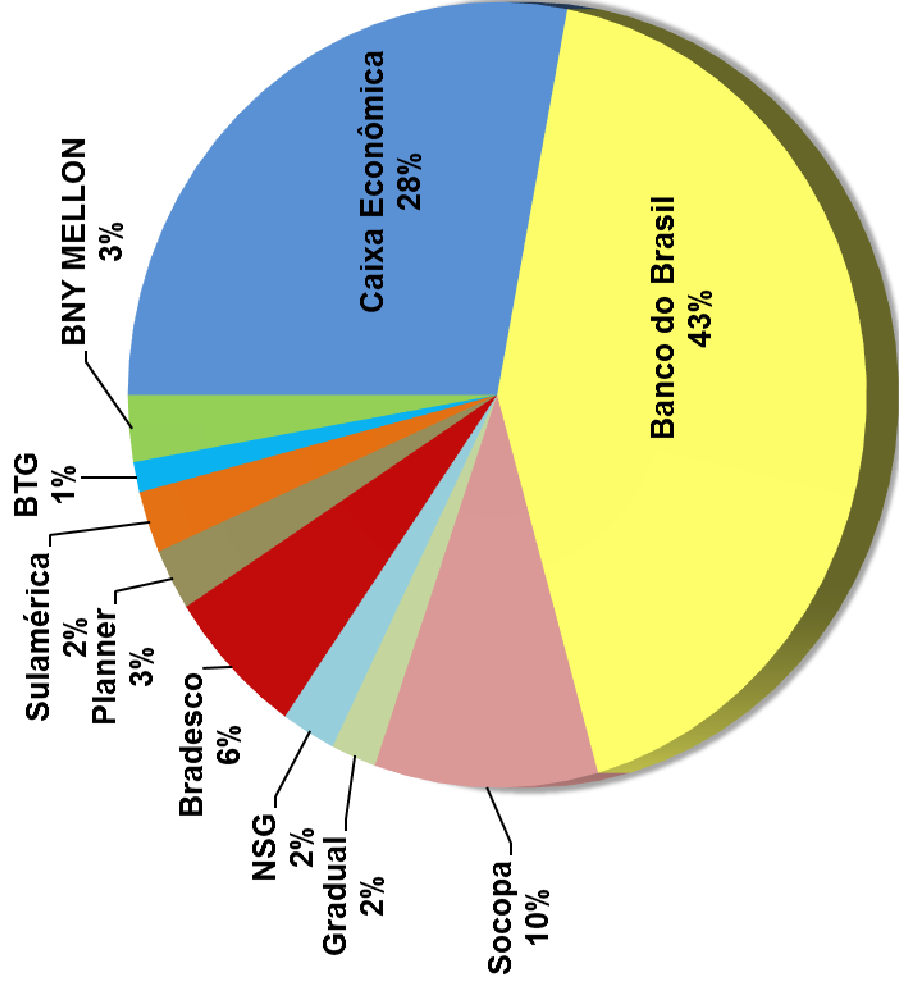
RESULTADOS ABSOLUTOS - TABELAS

COMPARAÇÕES DE FUNDOS

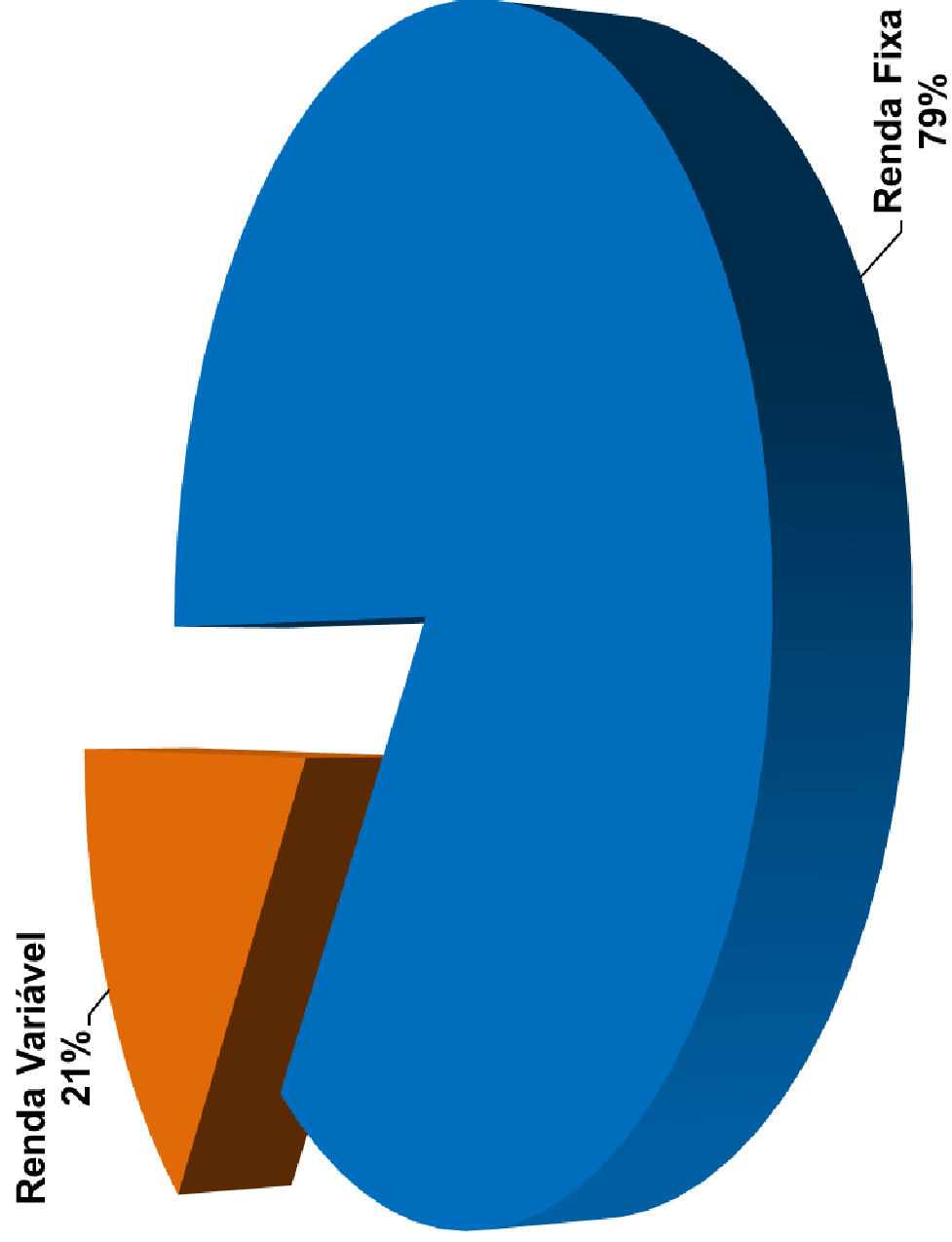
## Patrimônio Líquido



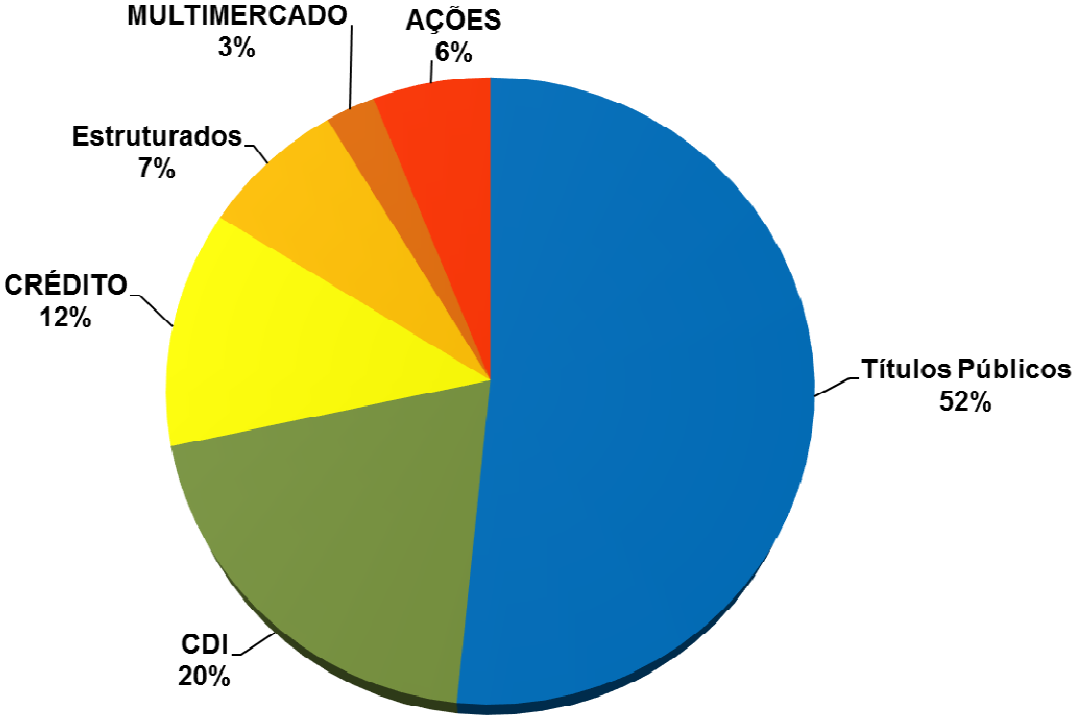
## Posição Consolidada Por Instituição Financeira



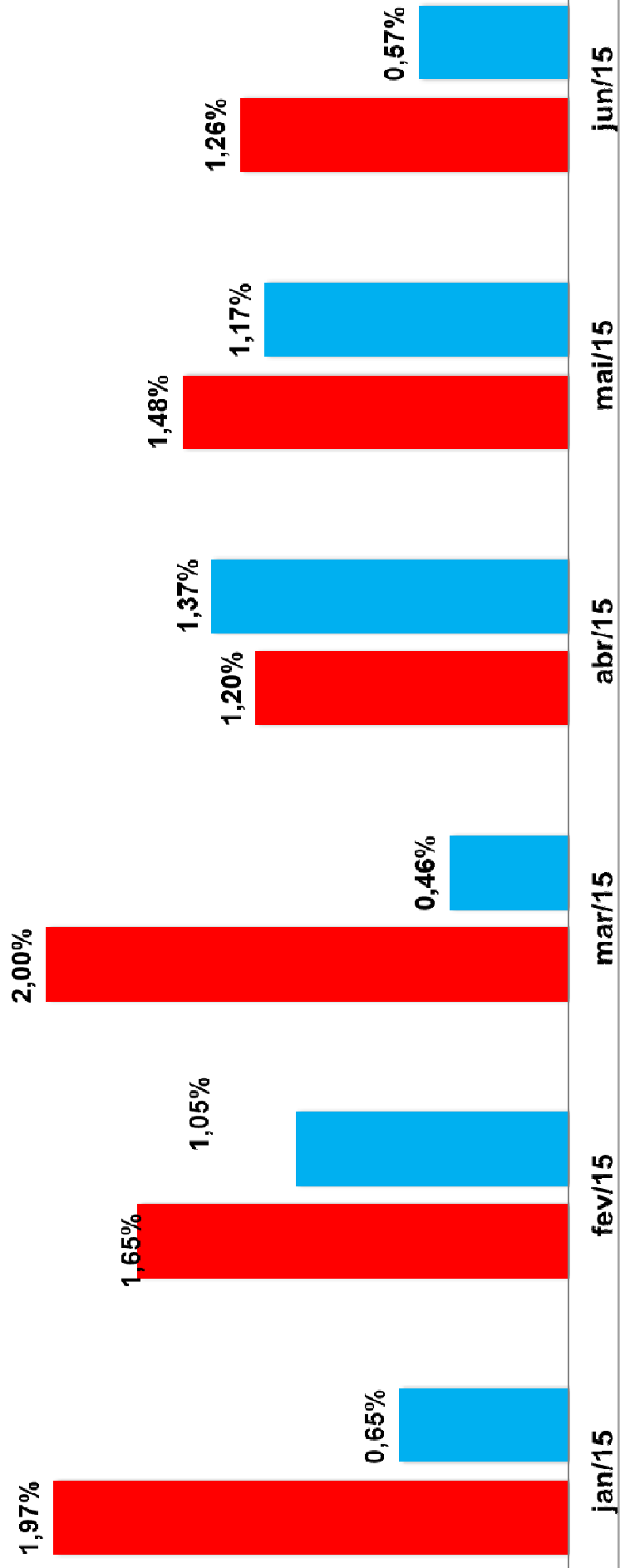
## Renda Fixa vs Renda Variável



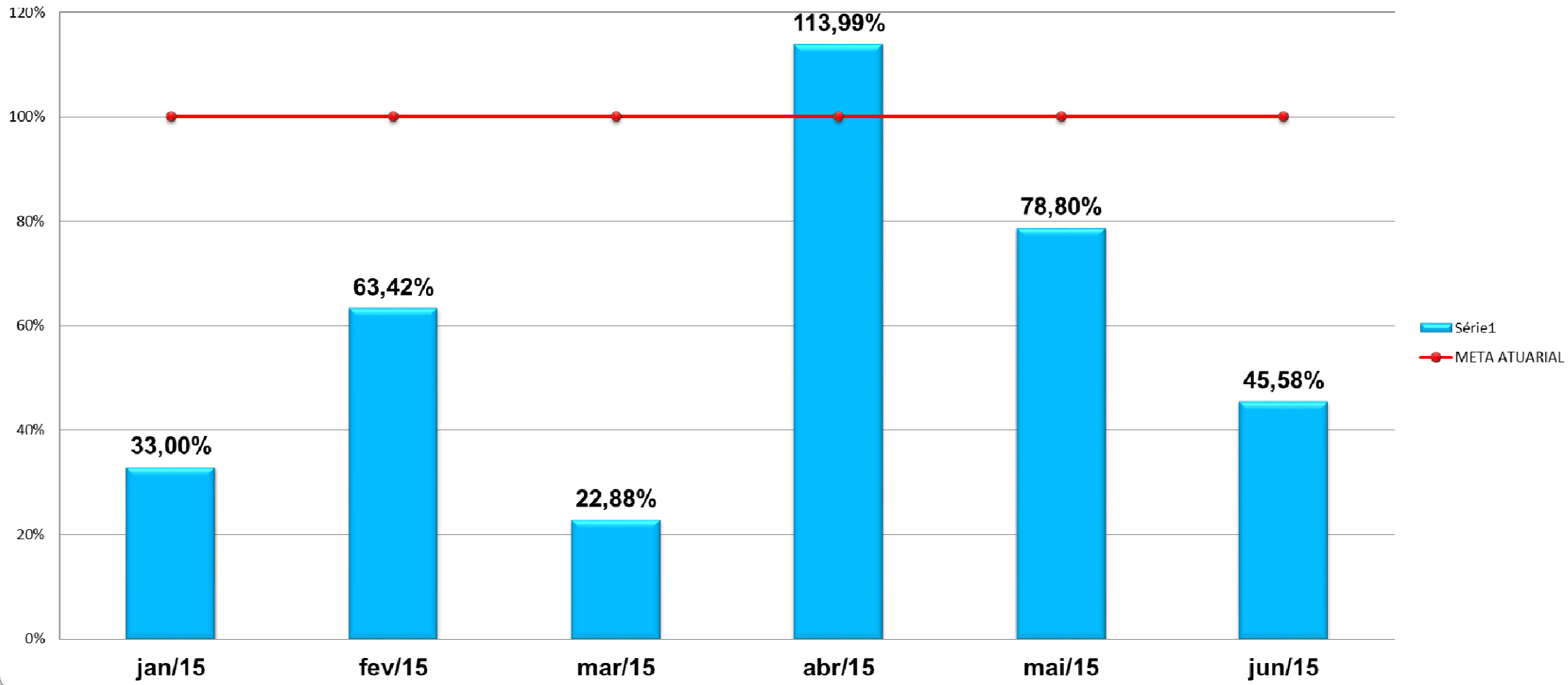
### Patrimônio por Classe de Ativos



## Funprei x Meta Atuarial Mensal

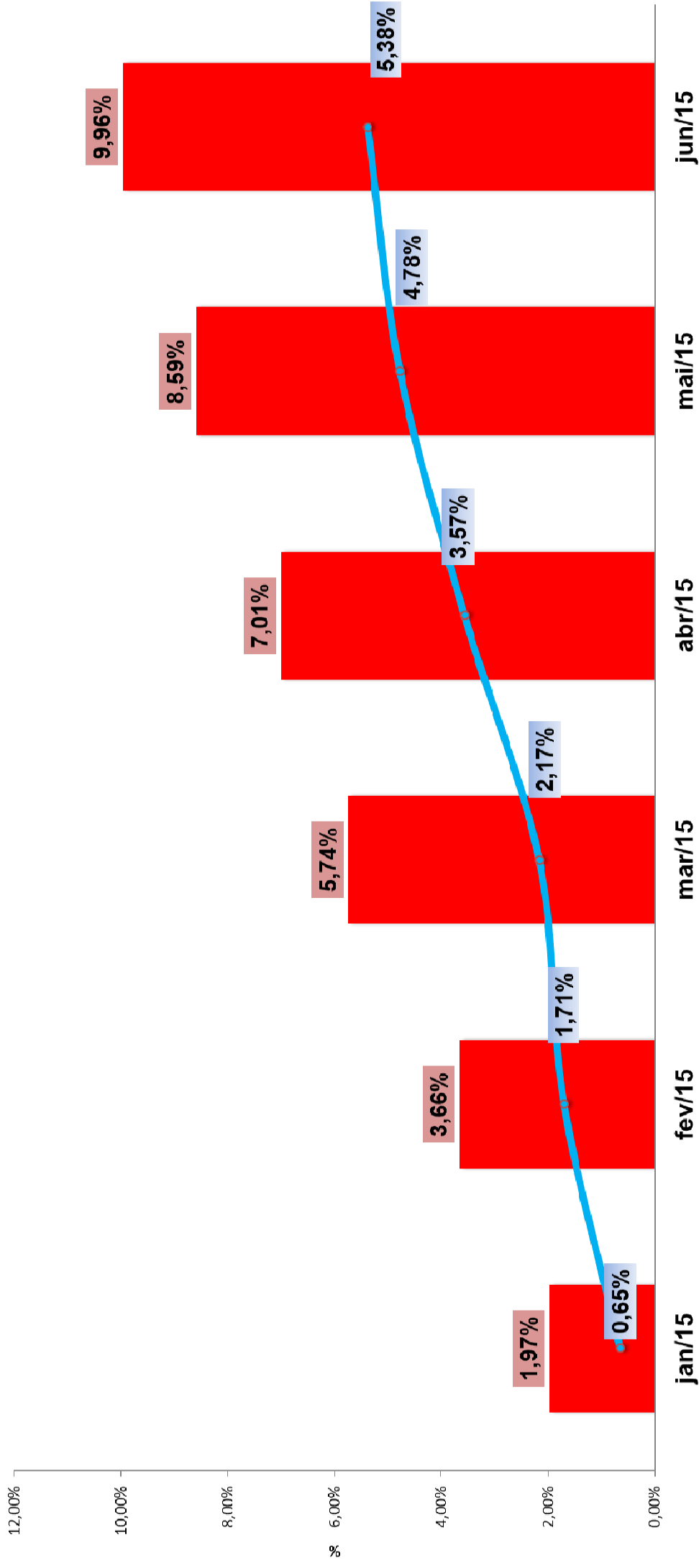


### BenchMark Mensal

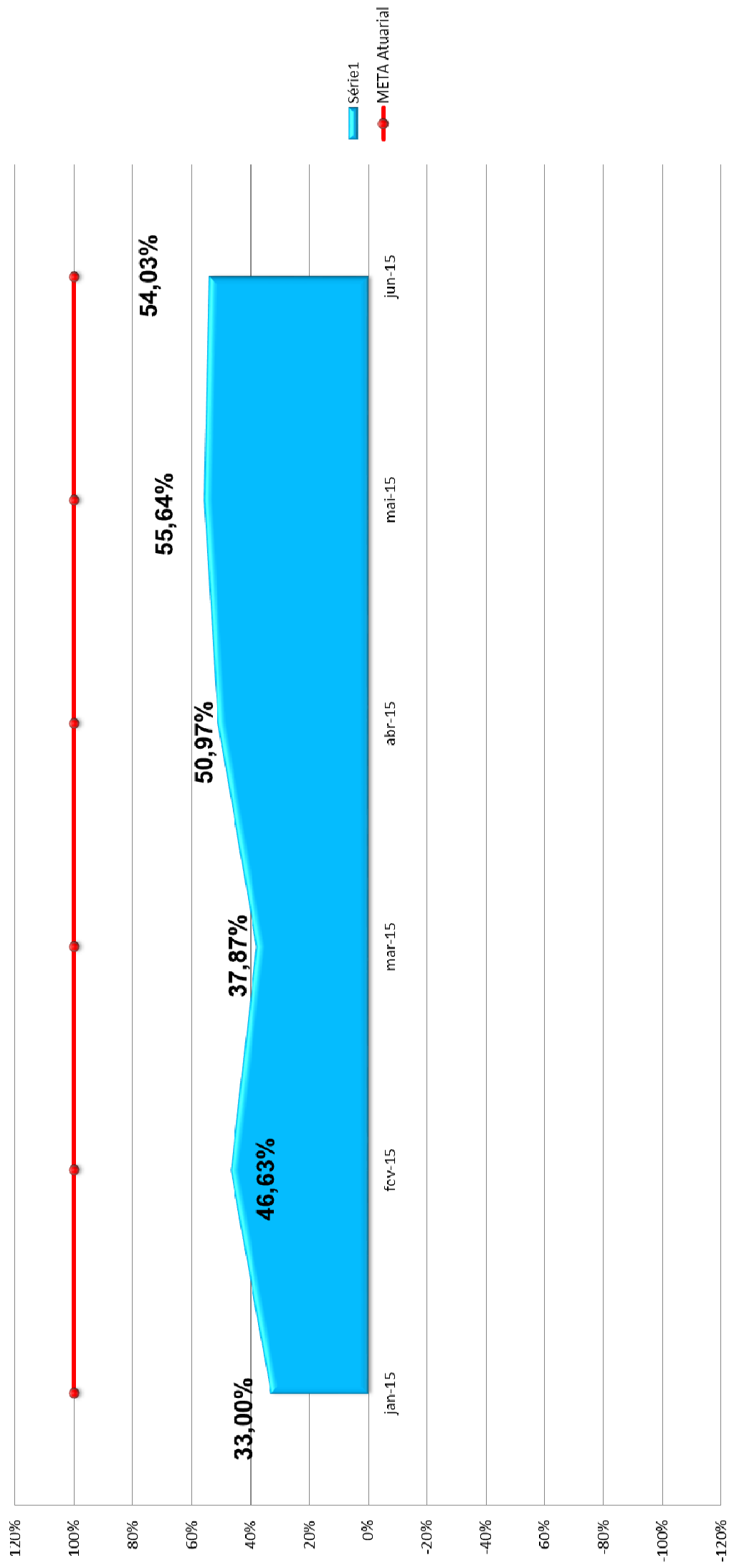




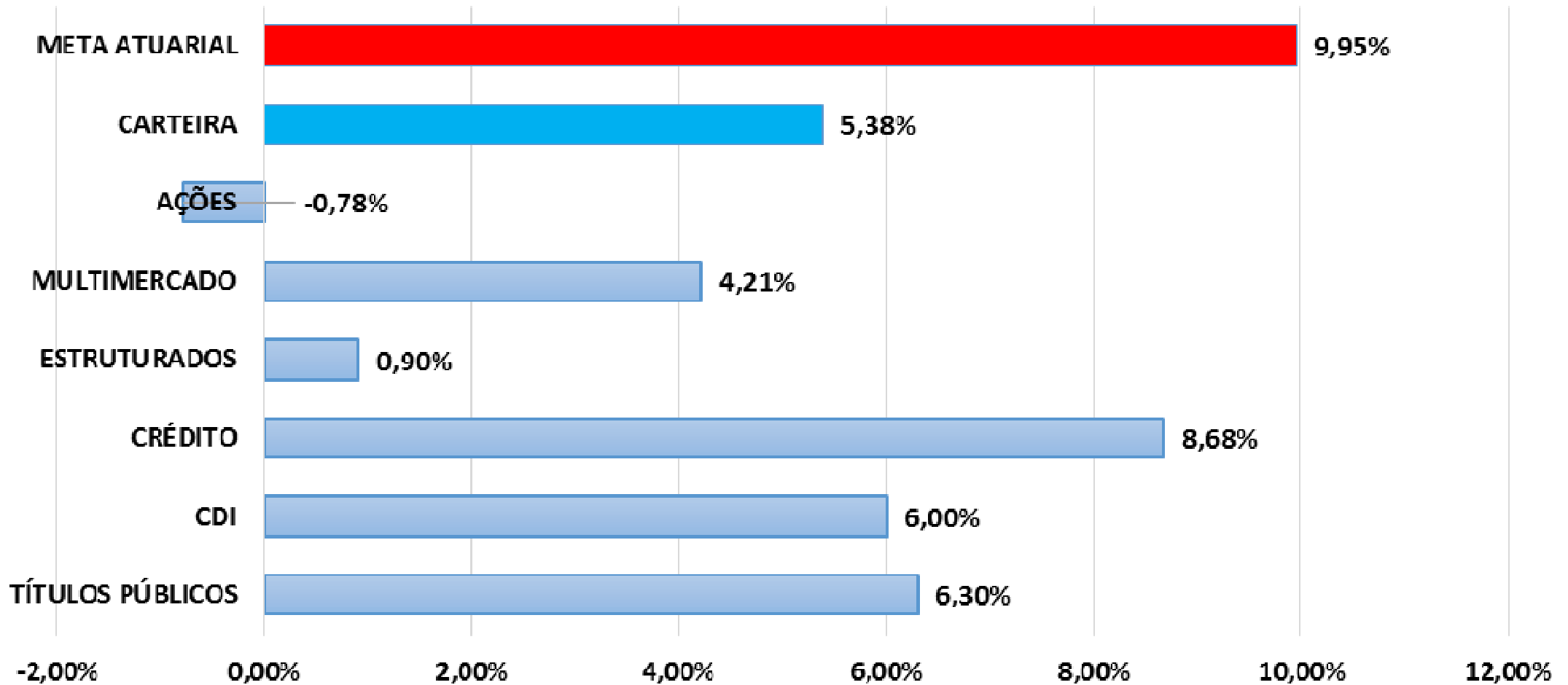
## Renatibilidade Acumulada vs Meta Atuarial



# BenchMark Acumulado



## Rentabilidade Acumulada - Segmento



Rentabilidade

Underwater

Volatilidade

Correlação

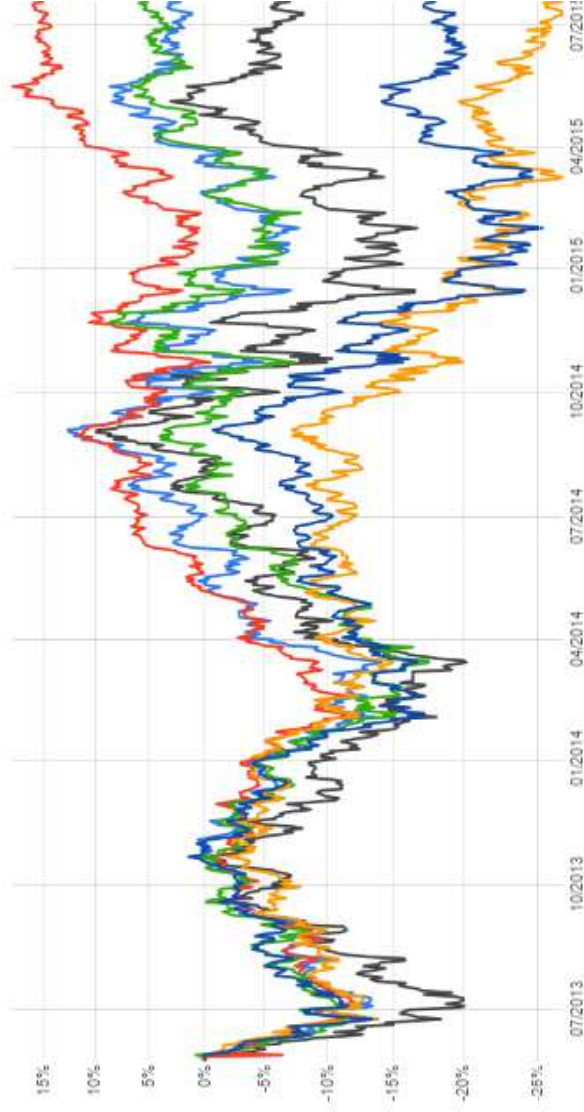
CDI

Ibovespa

Último

3 anos

Personalizado



■ IBOVESPA

Rentab. absoluta: -7,11% Rentab. relativa: 0,00 p.p.

Consistência: N/A

Sharpe (risco/retorno): N/A

Risco: 23,27%

■ BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 2,04% Rentab. relativa: 9,15 p.p.

Consistência: 86,69%

Sharpe (risco/retorno): 0,24

Risco: 18,03%

■ BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 14,90% Rentab. relativa: 22,01 p.p.

Consistência: 92,41%

Sharpe (risco/retorno): 0,73

Risco: 13,73%

■ FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA CONSUMO

Rentab. absoluta: 4,96% Rentab. relativa: 12,08 p.p.

Consistência: 65,87%

Sharpe (risco/retorno): 0,33

Risco: 17,33%

■ FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INFRAESTRUTURA

Rentab. absoluta: -26,67% Rentab. relativa: -19,56 p.p.

Consistência: 0,00%

Sharpe (risco/retorno): -0,59

Risco: 17,16%

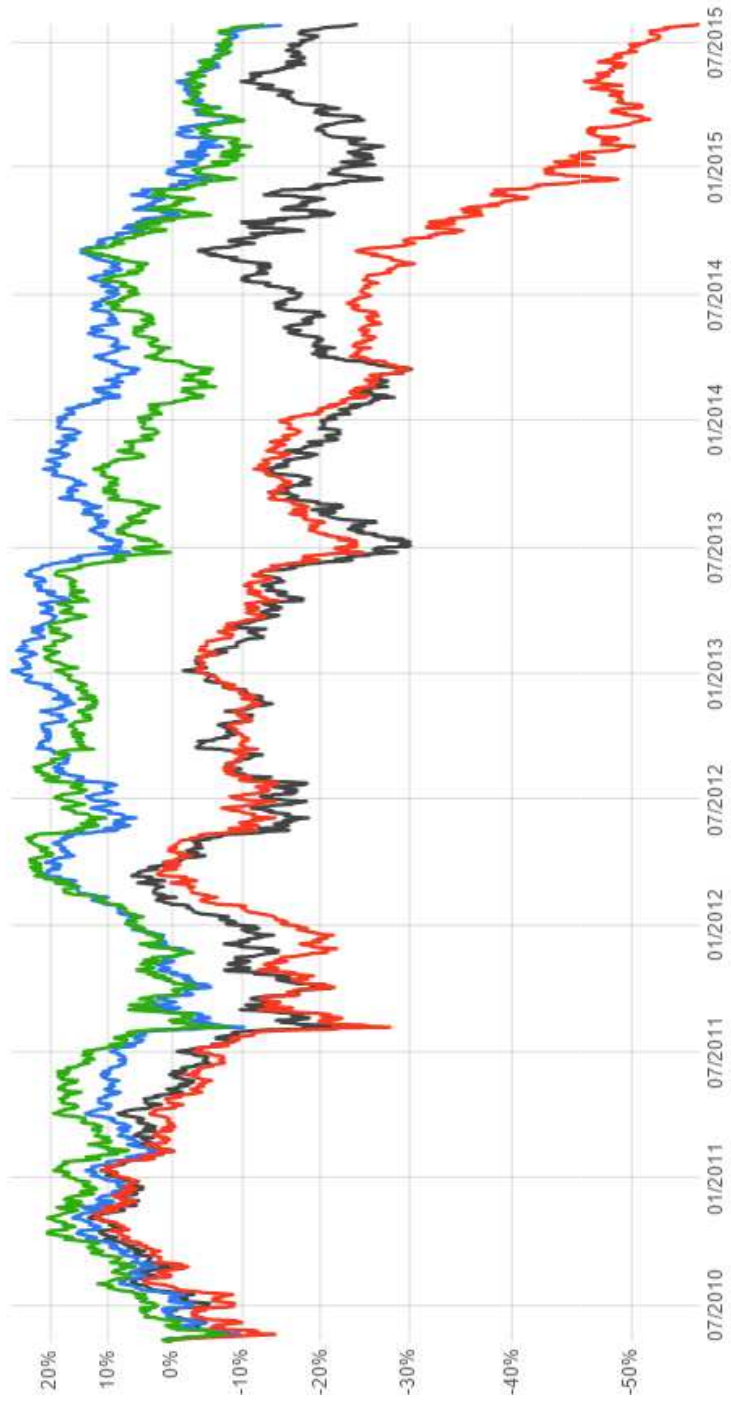
■ AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: -18,08% Rentab. relativa: -10,97 p.p.

Consistência: 0,00%

Sharpe (risco/retorno): -0,32

Risco: 17,34%



<b>IBOVESPA</b>	Rentab. absoluta: -24,35%	Rentab. relativa: 0,00 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): N/A	Risco: 22,37%
<b>FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INFRAESTRUTURA</b>	Rentab. absoluta: -15,11%	Rentab. relativa: 9,24 p.p.	Consistência: 68,96%	Sharpe (risco/retorno): 0,13	Risco: 16,68%
<b>BB ACOES INFRAESTRUTURA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>	Rentab. absoluta: -54,84%	Rentab. relativa: -30,49 p.p.	Consistência: 47,83%	Sharpe (risco/retorno): -0,46	Risco: 19,60%
<b>ITAÚ AÇÕES INFRA ESTRUTURA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>	Rentab. absoluta: -12,93%	Rentab. relativa: 11,43 p.p.	Consistência: 64,72%	Sharpe (risco/retorno): 0,15	Risco: 17,63%

