

Boletim Estatístico de Fundos de Investimento

Metodologia

OBJETIVO

Este relatório tem o objetivo de apresentar as principais informações dos Tipos ANBIMA de forma consolidada. O relatório é composto por gráficos e tabelas e reúne dados de rentabilidade, captação líquida e patrimônio líquido no mês e em 12 meses, além da série histórica dos últimos anos.

INDICADORES

1. Rentabilidade

1.1. Dispersão Risco-Retorno

Este indicador demonstra em forma de gráfico de dispersão a relação Risco-Retorno dos fundos. Neste gráfico, a rentabilidade dos fundos está distribuída no eixo vertical e a volatilidade no eixo horizontal. Para os dados mensais, a rentabilidade é acumulada no período (mês) e anualizada para 252 dias úteis (d.u.), e a volatilidade é calculada com retornos diários do período (mês) e anualizada para 252 d.u.

Neste gráfico, são excluídos os fundos considerados outliers. Para a definição de outliers é utilizada a regra de Tukey, a qual consiste em excluir as observações que estiverem acima de determinado limite superior ou abaixo de um limite inferior. Os limites são calculados conforme fórmula abaixo:

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

Limite Inferior = 1º Quartil – 3 x IQR

Limite Superior = 3º Quartil + 3 x IQR

Onde:

IQR = 3º Quartil – 1º Quartil.

A Média do Tipo é resultado da média ponderada da rentabilidade pelo patrimônio líquido diário de todos os fundos do Tipo ANBIMA.

1.2. Distribuição de Frequência – Rentabilidade

A distribuição de frequência de Rentabilidade está disposta em gráfico de barras verticais onde cada barra representa o percentual de fundos com Rentabilidade em cada intervalo. O gráfico possui 21 barras, sendo que a primeira representa o percentual de fundos com Rentabilidade inferior ao 10º percentil, e a vigésima primeira barra representa o percentual de fundos com Rentabilidade superior ao 90º percentil. As demais barras possuem intervalo definido pela amplitude das Rentabilidades entre a 1ª e 21ª barra dividida por 20.

1.3. Distribuição de Frequência – Volatilidade

A distribuição de frequência de Volatilidade está disposta em gráfico de barras verticais onde cada barra representa o percentual de fundos com Volatilidade em cada intervalo. O gráfico possui 21 barras, sendo que a primeira representa o percentual de fundos com Volatilidade inferior ao 10º percentil, e a vigésima primeira barra representa o percentual de fundos com Volatilidade superior ao 90º percentil. As demais barras possuem intervalo definido pela amplitude das Volatilidades entre a 1ª e 21ª barra dividida por 20.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

www.anbima.com.br

1.4. Dados Estatísticos

Neste quadro é informado a Média Aritmética, Média Ponderada pelo PL, Mediana, Dispersão (desvio padrão), 1º e 3º Quartis da rentabilidade acumulada no mês e em 12 meses dos fundos.

2. Dados Históricos

2.1. Rentabilidade Histórica

Na tabela de Rentabilidade Histórica estão as rentabilidades do Tipo ANBIMA e dos principais índices do mercado, acumuladas anualmente, dos últimos 3 anos mais o ano corrente.

2.2. Captação Histórica

Na tabela de Captação Histórica estão as captações do Tipo ANBIMA, acumuladas trimestralmente, dos últimos 3 anos mais o ano corrente.

2.3. Evolução do Patrimônio Líquido

A Evolução do Patrimônio Líquido está disposta em gráfico de área com o PL histórico do Tipo ANBIMA desde 2001, ou início do mesmo.

2.4. Evolução % do Tipo no Total Doméstico

Este gráfico demonstra a evolução da relação % do Tipo ANBIMA em comparação com o total de patrimônio líquido da indústria de Fundos de Investimento.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230