

RENTABILIDADECarteira Investimentos PLANO e PGA
Relatório Analítico

POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2016

	jan/2016	fev/2016	mar/2016	abr/2016	mai/2016	jun/2016	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	1,51%	0,95%	0,44%	0,64%	0,98%	0,47%	5,09%		
IPCA	1,27%	0,90%	0,43%	0,61%	0,78%	0,35%	4,42%		
IGP-M	1,14%	1,29%	0,51%	0,33%	0,82%	1,69%	5,91%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,63%	0,60%	0,72%	0,63%	0,65%	0,71%	4,00%		
CDI	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	6,71%		
IMA-B	1,91%	2,26%	5,31%	3,93%	-0,10%	1,93%	16,15%		
****IHFA (Anbima)	1,41%	0,87%	-0,40%	2,37%	0,85%	1,28%	6,53%		
IBX	-6,25%	5,29%	15,41%	7,14%	-9,41%	6,48%	17,73%		
IBOVESPA	-6,79%	5,91%	16,97%	7,70%	-10,09%	6,30%	18,86%		
S&P	-1,72%	-1,97%	-4,67%	-2,77%	5,77%	-10,64%	-15,60%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2016	fev/2016	mar/2016	abr/2016	mai/2016	jun/2016	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	1,66%	2,05%	3,62%	2,96%	0,42%	1,53%	12,85%		
Renda variável	-5,24%	4,97%	10,52%	5,03%	-5,50%	4,89%	14,45%		
Investimentos Estruturados	-2,82%	0,44%	2,24%	2,50%	0,79%	0,07%	3,17%		
Investimentos no Exterior **	-8,27%	0,98%	-3,34%	-2,36%	5,03%	-15,00%	-21,95%		
Operações com Particip.	1,21%	1,28%	1,37%	1,20%	1,34%	1,23%	7,88%		
CARTEIRA GLOBAL	1,00%	2,02%	3,56%	2,84%	0,31%	1,47%	11,70%		
METAS									
Renda fixa (CDI)	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	6,71%		
Renda variável (Ibovespa)	-6,79%	5,91%	16,97%	7,70%	-10,09%	6,30%	18,86%		
Inv. Estruturados (IHFA)	1,41%	0,87%	-0,40%	2,37%	0,85%	1,28%	6,53%		
Investimentos no Exterior (S&P)	-1,72%	-1,97%	-4,67%	-2,77%	5,77%	-10,64%	-15,60%		
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	1,88%	1,32%	0,81%	1,01%	1,35%	0,84%	7,43%		
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	6,71%		
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	1,88%	1,32%	0,81%	1,01%	1,35%	0,84%	7,43%		

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	1,03%	1,07%	1,28%	1,06%	1,15%	1,06%	6,84%		
Meta PGA (95% CDI + 5% IMAB)	1,09%	1,06%	1,37%	1,19%	1,05%	1,20%	7,17%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,28%	1,35%	1,41%	1,25%	1,41%	1,29%	8,26%		
Rentabilidade Total bruta	1,00%	2,03%	3,56%	2,84%	0,32%	1,47%	11,72%		
Rentabilidade Total líquida	1,00%	2,02%	3,56%	2,84%	0,31%	1,47%	11,70%		

* Índice de ações do mercado mundial, incluindo o Brasil. O percentual indica rentabilidade em R\$;

** Início em 08/01/2014; e

*** CARTEIRA PLANO / Da cota bruta são descontadas provisões do empréstimo pessoal (FQM e FIRF).

**** IHFA - Informações disponíveis a partir de JAN 2016

RENTABILIDADECarteira Investimentos PLANO e PGA
Relatório Analítico

POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2016

	jul/2016	ago/2016	set/2016	out/2016	nov/2016	dez/2016	2016	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,64%	0,31%	0,08%	0,17%	0,07%	0,14%	6,58%	18,60%	25,98%
IPCA	0,52%	0,44%	0,08%	0,26%	0,18%	0,30%	6,29%	17,63%	25,17%
IGP-M	0,18%	0,15%	0,20%	0,16%	-0,03%	0,54%	7,19%	18,49%	22,85%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,66%	0,76%	0,66%	0,66%	0,64%	0,69%	8,30%	17,06%	25,34%
CDI	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	13,99%	29,08%	43,03%
IMA-B	2,51%	0,89%	1,57%	0,64%	-1,22%	2,91%	24,82%	35,90%	55,66%
***IHFA (Anbima)	1,61%	1,50%	1,39%	1,93%	-0,24%	2,29%	15,87%	15,87%	15,87%
IBX	11,31%	1,12%	0,60%	10,75%	-5,00%	-2,55%	36,68%	19,73%	16,41%
IBOVESPA	11,22%	1,03%	0,80%	11,23%	-4,65%	-2,71%	38,91%	20,44%	16,93%
S&P	4,50%	-0,08%	0,06%	-3,91%	10,43%	-2,30%	-8,58%	33,42%	68,51%

CARTEIRA PLANO

	jul/2016	ago/2016	set/2016	out/2016	nov/2016	dez/2016	2016	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	2,08%	1,15%	1,46%	0,75%	-0,33%	2,38%	21,54%	34,68%	54,65%
Renda variável	10,34%	0,08%	-0,12%	9,55%	-6,07%	-2,54%	26,59%	11,49%	7,78%
Investimentos Estruturados	4,95%	1,95%	3,78%	2,14%	-1,93%	0,12%	14,89%	32,39%	49,17%
Investimentos no Exterior **	7,32%	1,75%	0,27%	-3,06%	7,58%	-1,67%	-12,37%	25,48%	47,87%
Operações com Particip.	1,40%	1,44%	1,35%	1,26%	1,30%	1,28%	16,83%	37,45%	55,57%
CARTEIRA GLOBAL	2,51%	1,20%	1,47%	1,18%	-0,44%	1,98%	20,79%	32,75%	49,10%
METAS									
Renda fixa (CDI)	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	13,99%	32,54%	48,23%
Renda variável (Ibovespa)	11,22%	1,03%	0,80%	11,23%	-4,65%	-2,71%	38,91%	20,44%	16,94%
Inv. Estruturados (IHFA)	1,61%	1,50%	1,39%	1,93%	-0,24%	2,29%	15,87%	32,45%	41,89%
Investimentos no Exterior (S&P)	4,50%	-0,08%	0,06%	-3,91%	10,43%	-2,30%	-8,58%	30,71%	52,55%
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	1,01%	0,68%	0,45%	0,54%	0,44%	0,51%	11,38%	29,51%	48,61%
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	13,99%	32,54%	48,23%
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	1,01%	0,68%	0,45%	0,54%	0,44%	0,51%	11,38%	29,51%	43,78%

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	1,12%	0,97%	1,11%	1,04%	1,04%	1,15%	13,89%	28,60%	43,34%
Meta PGA (95% CDI + 5% IMAB)	1,18%	1,19%	1,13%	1,03%	0,93%	1,21%	14,52%	29,42%	43,67%

COTA BRUTA X LÍQUIDA *****

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,47%	1,52%	1,40%	1,37%	1,38%	1,36%	17,79%	38,73%	63,07%
Rentabilidade Total bruta	2,51%	1,21%	1,48%	1,19%	-0,44%	1,99%	20,86%	32,86%	49,71%
Rentabilidade Total líquida	2,51%	1,20%	1,47%	1,18%	-0,44%	1,98%	20,79%	32,75%	49,10%

* Índice de ações do mercado mundial, incluindo o Brasil. O percentual indica rentabilidade em R\$;

** Início em 08/01/2014; e

*** CARTEIRA PLANO / Da cota bruta são descontadas provisões do empréstimo pessoal (FQM e FIRF).

**** IHFA - Informações disponíveis a partir de JAN 2016