

RENTABILIDADECarteira Investimentos
Relatório Analítico

PLANO e PGA



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2017

	jan/2017	fev/2017	mar/2017	abr/2017	mai/2017	jun/2017	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	0,42%	0,24%	0,32%	0,08%	0,36%	-0,30%	1,12%		
IPCA	0,38%	0,33%	0,25%	0,14%	0,31%	-0,23%	1,18%		
IGP-M	0,64%	0,08%	0,01%	-1,10%	-0,93%	-0,67%	-1,97%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,67%	0,53%	0,65%	0,50%	0,58%	0,55%	3,54%		
CDI	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	5,67%		
IMA-B	1,87%	3,85%	1,04%	-0,32%	-1,19%	0,16%	5,45%		
****IHFA	1,85%	1,66%	1,07%	0,31%	-1,00%	1,19%	5,16%		
IBX	7,21%	3,30%	-2,35%	0,88%	-3,66%	0,30%	5,42%		
IBOVESPA	7,38%	3,08%	-2,52%	0,65%	-4,12%	0,30%	4,44%		
S&P (em reais)	-2,34%	2,96%	2,03%	1,86%	2,59%	2,48%	9,87%		
MSCI World (R\$)	-1,80%	1,79%	2,95%	2,29%	3,22%	2,24%	11,09%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2017	fev/2017	mar/2017	abr/2017	mai/2017	jun/2017	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	1,77%	3,22%	1,11%	-0,18%	-0,81%	0,27%	5,45%		
Renda variável	7,35%	3,11%	-1,37%	1,78%	-4,14%	1,09%	7,68%		
Investimentos Estruturados	2,76%	0,35%	1,39%	0,18%	-0,82%	1,35%	5,28%		
Investimentos no Exterior **	0,31%	2,56%	1,62%	3,66%	3,53%	2,54%	15,05%		
Operações com Particip.	1,40%	1,10%	1,66%	1,29%	1,44%	1,39%	8,57%		
CARTEIRA GLOBAL	1,99%	2,87%	1,09%	0,05%	-0,75%	0,46%	5,80%		
METAS									
Renda fixa (CDI)	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	5,67%		
Renda variável (Ibovespa)	7,38%	3,08%	-2,52%	0,65%	-4,12%	0,30%	4,44%		
Inv. Estrut.(90%(IPCA + 8%) + 10% CDI)	1,03%	0,96%	0,91%	0,78%	0,95%	0,45%	5,20%		
Investimentos no Exterior (MSCI)	-1,80%	1,79%	2,95%	2,29%	3,22%	2,24%	11,09%		
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	0,79%	0,61%	0,69%	0,45%	0,73%	0,07%	3,39%		
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	5,67%		
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,79%	0,61%	0,69%	0,45%	0,73%	0,07%	3,39%		

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	1,07%	0,93%	1,03%	0,77%	0,74%	0,95%	5,62%		
Meta PGA (CDI)	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	5,67%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,48%	1,14%	1,75%	1,34%	1,54%	1,45%	9,02%		
Rentabilidade Total bruta	1,99%	2,87%	1,10%	0,06%	-0,74%	0,46%	5,83%		
Rentabilidade Total líquida	1,99%	2,87%	1,09%	0,05%	-0,75%	0,46%	5,80%		

* 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
Relatório Analítico

PLANO e PGA



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2017

	jul/2017	ago/2017	set/2017	out/2017	nov/2017	dez/2017	2017	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,17%	-0,03%	-0,02%	0,37%	0,18%	0,26%	2,07%	8,78%	21,05%
IPCA	0,24%	0,19%	0,16%	0,42%	0,28%	0,44%	2,95%	9,42%	21,10%
IGP-M	-0,72%	0,10%	0,47%	0,20%	0,52%	0,89%	-0,53%	6,62%	17,86%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,56%	0,55%	0,50%	0,47%	0,43%	0,43%	6,61%	15,47%	24,80%
CDI	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,97%	25,35%	41,93%
IMA-B	4,00%	1,34%	1,81%	-0,38%	-0,76%	0,83%	12,79%	40,78%	53,28%
****IHFA	2,33%	1,39%	1,71%	0,25%	-0,30%	1,34%	12,40%	30,25%	30,25%
IBX	4,91%	7,35%	4,69%	-0,13%	-3,38%	6,34%	27,54%	74,35%	52,71%
IBOVESPA	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	26,85%	76,24%	52,78%
S&P (em reais)	-3,53%	0,58%	2,61%	5,73%	2,33%	2,42%	21,21%	10,81%	61,72%
MSCI World (R\$)	-3,16%	0,45%	2,76%	5,31%	1,51%	2,70%	21,91%	7,17%	53,22%

CARTEIRA PLANO

	jul/2017	ago/2017	set/2017	out/2017	nov/2017	dez/2017	2017	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	3,41%	1,24%	1,73%	-0,27%	-0,61%	0,75%	12,15%	36,29%	51,04%
Renda variável	5,53%	6,43%	5,86%	-0,81%	-3,77%	5,57%	29,01%	63,34%	43,83%
Investimentos Estruturados	0,04%	-1,24%	1,59%	0,18%	-0,08%	0,38%	6,18%	22,02%	40,59%
Investimentos no Exterior **	-3,14%	-0,71%	3,42%	6,40%	1,96%	2,61%	27,38%	11,62%	59,84%
Operações com Particip.	1,40%	1,48%	1,29%	1,55%	1,39%	1,36%	18,10%	37,98%	62,33%
CARTEIRA GLOBAL	3,13%	1,34%	1,89%	-0,12%	-0,56%	1,04%	13,06%	36,58%	50,12%
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,97%	25,36%	45,76%
Renda variável (Ibovespa)	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	26,85%	76,21%	52,79%
Inv. Estrut.(90%IPCA + 8%) + 10% CDI)	0,88%	0,83%	0,79%	1,02%	0,89%	1,03%	11,04%	28,67%	47,08%
Investimentos no Exterior (MSCI)	-3,16%	0,45%	2,76%	5,31%	1,51%	2,70%	21,91%	11,46%	59,36%
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	0,54%	0,34%	0,35%	0,74%	0,55%	0,63%	6,68%	18,83%	38,17%
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,97%	25,36%	45,76%
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,54%	0,34%	0,35%	0,74%	0,55%	0,63%	6,68%	18,83%	38,17%

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	0,80%	0,70%	0,80%	0,66%	0,54%	0,62%	10,04%	25,31%	41,51%
Meta PGA (CDI)	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,97%	25,93%	42,32%

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,48%	1,53%	1,38%	1,59%	1,46%	1,43%	19,05%	40,25%	65,16%
Rentabilidade Total bruta	3,14%	1,34%	1,89%	-0,11%	-0,55%	1,05%	13,14%	36,75%	50,32%
Rentabilidade Total líquida	3,13%	1,34%	1,89%	-0,12%	-0,56%	1,04%	13,06%	36,58%	50,12%

* 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