

RENTABILIDADECarteira Investimentos
Relatório Analítico

PLANO e PGA



Fundação de Seguridade Social

Ref.: dez/2018

POUPREV/DIRAF

	jan/2018	fev/2018	mar/2018	abr/2018	mai/2018	jun/2018	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	0,23%	0,18%	0,07%	0,21%	0,43%	1,43%	2,57%		
IPCA	0,29%	0,32%	0,09%	0,22%	0,40%	1,26%	2,60%		
IGP-M	0,76%	0,07%	0,64%	0,57%	1,38%	1,87%	5,40%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,40%	0,40%	0,39%	0,37%	0,37%	0,37%	2,32%		
CDI	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	3,18%		
IMA-B	3,40%	0,55%	0,94%	-0,14%	-3,16%	-0,32%	1,16%		
****IHFA	3,12%	0,59%	0,60%	0,58%	-2,20%	0,52%	3,18%		
IBX	10,75%	0,42%	0,08%	0,82%	-10,91%	-5,19%	-5,21%		
IBOVESPA	11,14%	0,52%	0,01%	0,88%	-10,87%	-5,20%	-4,76%		
S&P (em reais)	0,97%	-1,39%	-0,32%	5,02%	10,43%	2,97%	18,52%		
MSCI World (R\$)	0,59%	-1,81%	-0,11%	5,80%	8,07%	2,63%	15,77%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2018	fev/2018	mar/2018	abr/2018	mai/2018	jun/2018	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	2,69%	1,19%	0,79%	-0,06%	-2,94%	-0,21%	1,38%		
Renda variável	7,09%	-0,21%	-0,14%	0,18%	-9,65%	-3,42%	-6,71%		
Investimentos Estruturados	1,22%	2,48%	0,32%	0,01%	-1,82%	0,26%	2,44%		
Investimentos no Exterior **	2,09%	-0,72%	-3,33%	8,53%	6,43%	4,12%	17,84%		
Imobiliário	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%		
Operações com Particip.	1,49%	1,39%	1,36%	1,50%	1,37%	1,40%	8,82%		
CARTEIRA GLOBAL	3,13%	0,76%	0,76%	0,11%	-2,82%	-0,18%	1,68%		
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	3,18%		
Renda variável (Ibovespa)	11,14%	0,52%	0,01%	0,88%	-10,87%	-5,20%	-4,76%		
Inv. Estrut.(80%(IPCA + 8%) + (20%(CDI + 2%))	0,90%	0,90%	0,73%	0,83%	0,97%	1,66%	6,13%		
Investimentos no Exterior (MSCI)	0,59%	-1,81%	-0,11%	5,80%	8,07%	2,63%	15,77%		
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	0,60%	0,55%	0,44%	0,58%	0,80%	1,80%	4,86%		
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	3,18%		
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,60%	0,55%	0,44%	0,58%	0,80%	1,80%	4,86%		

CARTEIRA PGA

	jan/2018	fev/2018	mar/2018	abr/2018	mai/2018	jun/2018	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Aplicações PGA	0,53%	0,47%	0,56%	0,49%	0,42%	0,56%	3,07%		
Meta PGA (CDI)	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	3,18%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jan/2018	fev/2018	mar/2018	abr/2018	mai/2018	jun/2018	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,56%	1,42%	1,42%	1,56%	1,45%	1,46%	9,20%		
Rentabilidade Total bruta	3,14%	0,77%	0,77%	0,11%	-2,81%	-0,18%	1,72%		
Rentabilidade Total líquida	3,13%	0,76%	0,76%	0,11%	-2,82%	-0,18%	1,68%		

* 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/2018

	jul/2018	ago/2018	set/2018	out/2018	nov/2018	dez/2018	2018	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,25%	0,00%	0,30%	0,40%	-0,25%	0,14%	3,43%	5,57%	12,52%
IPCA	0,33%	-0,09%	0,48%	0,45%	-0,21%	0,15%	3,75%	6,80%	13,52%
IGP-M	0,51%	0,70%	1,52%	0,89%	-0,49%	-1,08%	7,55%	6,98%	14,67%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	4,62%	11,54%	20,81%
CDI	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	17,01%	33,40%
IMA-B	2,32%	-0,45%	-0,15%	7,14%	0,90%	1,65%	13,06%	27,52%	59,16%
****IHFA	1,07%	0,07%	0,47%	2,00%	0,10%	0,03%	7,08%	20,38%	39,48%
IBX	8,84%	-3,13%	3,23%	10,42%	2,66%	-1,29%	15,43%	47,21%	101,24%
IBOVESPA	8,88%	-3,21%	3,48%	10,19%	2,38%	-1,81%	15,04%	45,93%	102,74%
S&P (em reais)	0,89%	13,46%	-2,76%	-13,59%	5,77%	-8,91%	9,83%	33,12%	21,71%
MSCI World (R\$)	0,36%	11,28%	-2,80%	-14,04%	4,91%	-7,44%	4,90%	27,90%	12,43%

CARTEIRA PLANO

	jul/2018	ago/2018	set/2018	out/2018	nov/2018	dez/2018	2018	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	2,33%	-0,15%	-0,13%	6,38%	1,04%	1,49%	12,85%	26,57%	53,83%
Renda variável	5,89%	-4,02%	0,79%	12,80%	4,09%	2,07%	14,52%	47,74%	87,04%
Investimentos Estruturados	1,78%	-0,50%	1,73%	2,90%	1,22%	1,20%	11,25%	18,14%	35,75%
Investimentos no Exterior **	0,06%	8,70%	0,48%	-14,81%	4,77%	-7,94%	5,82%	34,78%	18,11%
Imobiliário	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	2,90%	2,90%	2,90%	2,90%
Operações com Particip.	1,50%	1,42%	1,41%	1,57%	1,28%	1,69%	18,83%	40,33%	63,95%
CARTEIRA GLOBAL	2,37%	-0,16%	0,13%	5,95%	1,21%	1,51%	13,27%	28,09%	54,70%
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	17,03%	33,41%
Renda variável (Ibovespa)	8,88%	-3,21%	3,48%	10,19%	2,38%	-1,81%	15,04%	45,94%	102,72%
Inv. Estrut.(80%(IPCA + 8%) + (20%(CDI + 2%))	0,92%	0,59%	1,03%	1,02%	0,48%	0,77%	11,32%	23,61%	43,23%
Investimentos no Exterior (MSCI)	0,36%	11,28%	-2,80%	-14,04%	4,91%	-7,44%	4,90%	27,90%	16,93%
Op. Particip. (INPC + 4,5% aa)	0,62%	0,37%	0,67%	0,77%	0,12%	0,51%	8,11%	15,33%	28,46%
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	17,03%	33,41%
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,62%	0,37%	0,67%	0,77%	0,12%	0,51%	8,11%	15,33%	28,46%

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	0,42%	0,68%	0,55%	0,54%	0,48%	0,58%	6,46%	17,13%	33,38%
Meta PGA (CDI)	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	17,03%	34,01%

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,57%	1,47%	1,47%	1,64%	1,33%	1,74%	19,67%	42,49%	67,86%
Rentabilidade Total bruta	2,37%	-0,21%	0,13%	5,96%	1,21%	1,51%	13,27%	28,16%	54,91%
Rentabilidade Total líquida	2,37%	-0,16%	0,13%	5,95%	1,21%	1,51%	13,27%	28,09%	54,70%

* 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