

RENTABILIDADECarteira Investimentos
Relatório Analítico

PLANO e PGA



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2019

	jan/2019	fev/2019	mar/2019	abr/2019	mai/2019	jun/2019	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	0,36%	0,54%	0,77%	0,60%	0,15%	0,01%	2,45%		
IPCA	0,32%	0,43%	0,75%	0,57%	0,13%	0,01%	2,23%		
IGP-M	0,01%	0,88%	1,26%	0,92%	0,45%	0,80%	4,39%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	2,25%		
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	3,07%		
IMA-B	4,37%	0,55%	0,58%	1,51%	3,66%	3,73%	15,21%		
****IHFA	2,61%	-0,23%	-0,20%	0,52%	0,93%	1,51%	5,22%		
IBX	10,71%	-1,76%	-0,11%	1,06%	1,14%	4,40%	15,93%		
IBOVESPA	10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	0,70%	4,06%	14,88%		
S&P (em reais)	1,66%	5,41%	6,10%	5,23%	-6,69%	3,95%	16,05%		
MSCI World (R\$)	1,48%	5,27%	5,33%	4,65%	-6,19%	3,52%	14,35%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2019	fev/2019	mar/2019	abr/2019	mai/2019	jun/2019	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	4,21%	0,52%	0,55%	1,55%	3,56%	3,63%	14,79%		
Renda variável	10,11%	-2,17%	-0,89%	1,61%	2,05%	4,72%	15,93%		
Investimentos Estruturados	0,72%	2,95%	0,64%	0,10%	0,68%	2,35%	7,64%		
Investimentos no Exterior **	1,68%	5,95%	5,37%	3,97%	-5,44%	3,44%	15,44%		
Imobiliário	0,70%	-0,12%	2,03%	2,02%	2,61%	3,95%	11,67%		
Operações com Particip.	1,52%	1,36%	1,39%	1,52%	1,48%	1,27%	8,85%		
CARTEIRA GLOBAL	3,99%	0,56%	0,59%	1,51%	3,19%	3,50%	14,04%		
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	3,07%		
Renda variável (Ibovespa)	10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	0,70%	4,06%	14,88%		
Inv. Estrut.(80%(IPCA + 8%) + (20%(CDI + 2%))	0,91%	0,99%	1,24%	1,11%	0,76%	0,65%	5,79%		
Investimentos no Exterior (MSCI)	1,48%	5,27%	5,33%	4,65%	-6,19%	3,52%	14,35%		
Imobiliário (INPC+4,5% a.a.)	0,73%	0,91%	1,14%	0,97%	0,52%	0,38%	4,74%		
Op. Particip. (INPC + 4,5% a.a.)	0,73%	0,91%	1,14%	0,97%	0,52%	0,38%	4,74%		
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	3,07%		
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,73%	0,91%	1,14%	0,97%	0,52%	0,38%	4,74%		

CARTEIRA PGA

	jan/2019	fev/2019	mar/2019	abr/2019	mai/2019	jun/2019	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Aplicações PGA	0,58%	0,48%	0,39%	0,61%	0,57%	0,43%	3,10%		
Meta PGA (CDI)	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	3,07%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jan/2019	fev/2019	mar/2019	abr/2019	mai/2019	jun/2019	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,57%	1,39%	1,44%	1,58%	1,55%	1,31%	9,17%		
Rentabilidade Total bruta	4,00%	0,56%	0,60%	1,51%	3,16%	3,51%	14,04%		
Rentabilidade Total líquida	3,99%	0,56%	0,59%	1,51%	3,19%	3,50%	14,04%		

* 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/2019

	jul/2019	ago/2019	set/2019	out/2019	nov/2019	dez/2019	2019	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,10%	0,12%	-0,05%	0,04%	0,54%	1,22%	4,48%	8,07%	10,30%
IPCA	0,19%	0,11%	-0,04%	0,10%	0,51%	1,15%	4,31%	8,21%	11,40%
IGP-M	0,40%	-0,67%	-0,01%	0,68%	0,30%	2,09%	7,32%	15,42%	14,81%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,37%	0,34%	0,32%	0,32%	0,29%	0,26%	4,20%	9,02%	16,23%
CDI	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	12,77%	24,00%
IMA-B	1,29%	-0,40%	2,86%	3,36%	-2,45%	2,01%	22,97%	39,01%	56,79%
****IHFA	0,85%	0,52%	0,46%	1,34%	-0,21%	2,54%	11,12%	19,00%	33,76%
IBX	0,88%	-0,16%	3,21%	2,20%	0,97%	7,27%	33,40%	53,96%	96,37%
IBOVESPA	0,84%	-0,67%	3,57%	2,36%	0,95%	6,85%	31,58%	51,36%	92,01%
S&P (em reais)	-0,47%	7,93%	2,35%	-1,88%	9,08%	-1,85%	34,03%	47,24%	78,47%
MSCI World (R\$)	-1,34%	7,46%	2,58%	-1,49%	8,27%	-1,82%	30,23%	36,62%	66,56%

CARTEIRA PLANO

	jul/2019	ago/2019	set/2019	out/2019	nov/2019	dez/2019	2019	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	1,28%	-0,21%	2,68%	3,19%	-2,38%	1,95%	22,34%	38,08%	54,85%
Renda variável	4,59%	2,09%	1,84%	2,47%	2,05%	9,17%	43,91%	64,81%	112,63%
Investimentos Estruturados	1,27%	0,59%	0,25%	-0,56%	1,11%	0,53%	11,11%	23,62%	31,27%
Investimentos no Exterior **	0,18%	5,86%	1,42%	0,55%	8,52%	-1,95%	32,84%	40,58%	79,07%
Imobiliário	3,47%	-4,63%	3,87%	7,47%	3,12%	14,05%	44,67%	48,86%	48,86%
Operações com Particip.	1,69%	1,41%	1,44%	1,50%	1,32%	1,60%	18,97%	41,36%	66,95%
CARTEIRA GLOBAL	1,53%	-0,05%	2,48%	3,01%	-1,53%	2,77%	23,63%	40,06%	58,38%
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	12,77%	24,01%
Renda variável (Ibovespa)	0,84%	-0,67%	3,57%	2,36%	0,95%	6,85%	31,58%	51,37%	92,02%
Inv. Estrut.(80%(IPCA + 8%) + (20%(CDI + 2%))	0,81%	0,74%	0,61%	0,72%	1,03%	1,54%	11,70%	24,34%	38,07%
Investimentos no Exterior (MSCI)	-1,34%	7,46%	2,58%	-1,49%	8,27%	-1,82%	30,23%	36,62%	66,56%
Imobiliário (INPC+4,5% a.a.)	0,47%	0,49%	0,32%	0,41%	0,91%	1,59%	9,20%	0,00%	0,00%
Op. Particip. (INPC + 4,5% a.a.)	0,47%	0,49%	0,32%	0,41%	0,91%	1,59%	9,20%	18,05%	25,94%
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	12,77%	24,01%
META ATUARIAL (INPC + 4,5% aa)	0,47%	0,49%	0,32%	0,41%	0,91%	1,59%	9,20%	18,05%	25,94%

CARTEIRA PGA

	jul/2019	ago/2019	set/2019	out/2019	nov/2019	dez/2019	2019	últ. 24m	últ. 36m
Aplicações PGA	0,51%	0,51%	0,51%	0,55%	0,30%	0,41%	6,01%	12,84%	24,17%
Meta PGA (CDI)	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	12,77%	24,01%

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jul/2019	ago/2019	set/2019	out/2019	nov/2019	dez/2019	2019	últ. 24m	últ. 36m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,75%	1,49%	1,54%	1,55%	1,41%	1,64%	19,82%	43,38%	70,70%
Rentabilidade Total bruta	1,54%	-0,05%	2,49%	3,01%	-1,52%	2,77%	23,67%	40,07%	58,48%
Rentabilidade Total líquida	1,53%	-0,05%	2,48%	3,01%	-1,53%	2,77%	23,63%	40,06%	58,38%

* 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