

RENTABILIDADECarteira Investimentos
Relatório Analítico

PLANO e PGA



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2020

	jan/2020	fev/2020	mar/2020	abr/2020	mai/2020	jun/2020	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	0,19%	0,17%	0,18%	-0,23%	-0,25%	0,30%	0,36%		
IPCA	0,21%	0,25%	0,07%	-0,31%	-0,38%	0,26%	0,10%		
IGP-M	0,48%	-0,04%	1,24%	0,80%	0,28%	1,56%	4,39%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,26%	0,26%	0,24%	0,22%	0,22%	0,17%	1,38%		
CDI	0,38%	0,29%	2,05%	-1,39%	0,24%	0,22%	1,77%		
IMA-B	0,26%	0,45%	-6,97%	1,31%	1,52%	2,05%	-1,66%		
****IHFA	0,56%	-1,57%	-6,24%	2,90%	1,87%	1,81%	-0,96%		
IBX	-1,25%	-8,22%	-30,09%	10,27%	8,52%	8,97%	-17,38%		
IBOVESPA	-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	-17,80%		
S&P (em reais)	5,75%	-3,49%	1,10%	17,63%	4,51%	2,77%	30,36%		
MSCI World (R\$)	5,20%	-3,69%	-0,01%	15,67%	4,62%	3,45%	26,83%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2020	fev/2020	mar/2020	abr/2020	mai/2020	jun/2020	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	0,34%	0,45%	-6,87%	-0,24%	1,34%	1,96%	-3,24%		
Renda variável	1,70%	-7,22%	-33,08%	13,47%	8,99%	10,66%	-13,58%		
Investimentos Estruturados	0,47%	3,83%	0,78%	-0,69%	2,12%	1,43%	8,14%		
Investimentos no Exterior **	7,35%	-6,12%	0,38%	16,32%	2,68%	3,55%	25,12%		
Imobiliário	-9,31%	-2,09%	-11,48%	0,21%	5,02%	8,76%	-10,03%		
Operações com Particip.	0,95%	1,31%	1,51%	1,48%	1,41%	1,58%	8,53%		
CARTEIRA GLOBAL	0,32%	-0,20%	-8,74%	1,25%	2,08%	2,94%	-2,79%		
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,38%	0,29%	2,05%	-1,39%	0,24%	0,22%	1,77%		
Renda variável (Ibovespa)	-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	-17,80%		
Inv. Estrut.(35%(IPCA + 7%) + (65%(CDI + 2%))	0,63%	0,58%	1,66%	-0,71%	0,33%	0,54%	3,05%		
Investimentos no Exterior (MSCI)	5,20%	-3,69%	-0,01%	15,67%	4,62%	3,45%	26,83%		
Imobiliário (IFIX)	-2,93%	-3,38%	-16,66%	5,11%	2,08%	5,59%	-11,45%		
Op. Particip. (INPC + 4,1% a.a.)	0,53%	0,51%	0,52%	0,10%	0,08%	0,64%	2,40%		
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,38%	0,29%	2,05%	-1,39%	0,24%	0,22%	1,77%		
META ATUARIAL (INPC + 4,1% aa)	0,53%	0,51%	0,52%	0,10%	0,08%	0,64%	2,40%		

CARTEIRA PGA

	jan/2020	fev/2020	mar/2020	abr/2020	mai/2020	jun/2020	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Aplicações PGA	0,35%	0,37%	0,08%	0,24%	0,37%	0,32%	1,74%		
Meta PGA (CDI)	0,38%	0,29%	2,05%	-1,39%	0,24%	0,22%	1,77%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jan/2020	fev/2020	mar/2020	abr/2020	mai/2020	jun/2020	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,24%	1,38%	1,59%	1,56%	1,50%	1,66%	9,27%		
Rentabilidade Total bruta	0,34%	-0,20%	-8,73%	1,25%	2,09%	2,94%	-2,75%		
Rentabilidade Total líquida	0,32%	-0,20%	-8,74%	1,25%	2,08%	2,94%	-2,79%		

* 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



Ref.: dez/2020

POUPREV/DIRAF

	jul/2020	ago/2020	set/2020	out/2020	nov/2020	dez/2020	2020	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,44%	0,36%	0,87%	0,89%	0,95%	1,46%	5,45%	10,17%	13,96%
IPCA	0,36%	0,24%	0,64%	0,86%	0,89%	1,35%	4,52%	9,02%	13,10%
IGP-M	2,23%	2,74%	4,34%	3,23%	3,28%	0,96%	23,14%	32,15%	42,13%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,13%	0,13%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	2,11%	6,40%	11,32%
CDI	0,19%	0,16%	0,19%	0,13%	0,15%	0,16%	2,77%	8,90%	15,90%
IMA-B	4,39%	-1,80%	-1,51%	0,21%	2,00%	4,78%	6,33%	30,74%	47,81%
****IHFA	2,68%	0,25%	-1,90%	-0,28%	2,99%	2,68%	5,47%	17,21%	25,52%
IBX	8,41%	-3,38%	-4,58%	-0,55%	15,46%	9,15%	3,50%	38,06%	59,35%
IBOVESPA	8,27%	-3,44%	-4,80%	-0,69%	15,94%	9,26%	2,93%	35,42%	55,78%
S&P (em reais)	0,26%	12,52%	-0,95%	-0,51%	2,31%	1,09%	49,89%	100,95%	120,70%
MSCI World (R\$)	-0,53%	12,02%	-0,61%	-0,89%	4,07%	1,50%	47,04%	91,50%	100,90%

CARTEIRA PLANO

	jul/2020	ago/2020	set/2020	out/2020	nov/2020	dez/2020	2020	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	4,50%	-1,95%	-1,47%	0,30%	2,00%	5,20%	5,13%	28,61%	45,15%
Renda variável	10,68%	-1,24%	-5,63%	-1,01%	11,98%	7,96%	6,68%	53,55%	75,84%
Investimentos Estruturados	0,88%	1,00%	-0,19%	0,33%	0,35%	-0,45%	10,23%	22,49%	36,28%
Investimentos no Exterior **	2,11%	11,70%	-1,16%	-1,86%	8,61%	1,09%	51,98%	101,94%	113,68%
Imobiliário	-4,64%	-3,66%	2,12%	0,67%	0,38%	0,68%	-14,13%	24,22%	27,81%
Operações com Particip.	1,55%	1,13%	1,49%	1,48%	1,57%	1,45%	18,28%	40,71%	67,20%
CARTEIRA GLOBAL	4,45%	-1,41%	-1,62%	0,19%	3,02%	4,86%	6,59%	31,82%	49,30%
METAS									
Renda fixa (CDI)	0,19%	0,16%	0,19%	0,13%	0,15%	0,16%	2,77%	8,91%	15,90%
Renda variável (Ibovespa)	8,27%	-3,44%	-4,80%	-0,69%	15,94%	9,26%	2,93%	35,43%	55,80%
Inv. Estrut.(35%(IPCA + 7%) + (65%(CDI + 2%))	0,55%	0,49%	0,65%	0,69%	0,71%	0,88%	7,23%	19,78%	33,33%
Investimentos no Exterior (MSCI)	-0,53%	12,02%	-0,61%	-0,89%	4,07%	1,50%	47,04%	91,50%	100,90%
Imobiliário (FIX)	-2,61%	1,79%	0,46%	-1,01%	1,51%	2,19%	-9,44%	0,00%	0,00%
Op. Particip. (INPC + 4,1% a.a.)	0,78%	0,70%	1,21%	1,23%	1,29%	1,80%	9,79%	20,34%	30,10%
CARTEIRA GLOBAL (CDI)	0,19%	0,16%	0,19%	0,13%	0,15%	0,16%	2,77%	8,91%	15,90%
META ATUARIAL (INPC + 4,1% aa)	0,78%	0,70%	1,21%	1,23%	1,29%	1,80%	9,79%	20,34%	30,10%

CARTEIRA PGA

	jul/2020	ago/2020	set/2020	out/2020	nov/2020	dez/2020	2020	últ. 24m	últ. 36m
Aplicações PGA	0,26%	0,19%	0,02%	0,14%	0,22%	0,27%	2,87%	9,04%	16,07%
Meta PGA (CDI)	0,19%	0,16%	0,19%	0,13%	0,15%	0,16%	2,77%	8,91%	15,90%

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jul/2020	ago/2020	set/2020	out/2020	nov/2020	dez/2020	2020	últ. 24m	últ. 36m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,62%	1,61%	1,55%	1,54%	1,57%	1,54%	19,99%	43,73%	72,02%
Rentabilidade Total bruta	4,46%	-1,39%	-1,62%	0,20%	3,02%	4,86%	6,68%	31,93%	49,44%
Rentabilidade Total líquida	4,45%	-1,41%	-1,62%	0,19%	3,02%	4,86%	6,59%	31,82%	49,30%

* 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