

RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Relatório Analítico



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2012

	jan/2012	fev/2012	mar/2012	abr/2012	mai/2012	jun/2012	jul/2012	ago/2012	set/2012	out/2012	nov/2012	dez/2012	2012	Risco *
INFLAÇÃO														
INPC	0,51%	0,39%	0,18%	0,64%	0,55%	0,26%	0,43%	0,45%	0,63%	0,71%	0,54%	0,74%	6,20%	0,17%
IPCA	0,56%	0,45%	0,21%	0,64%	0,36%	0,08%	0,43%	0,41%	0,57%	0,59%	0,60%	0,79%	5,84%	0,19%
IGP-M	0,25%	-0,06%	0,43%	0,85%	1,02%	0,66%	1,34%	1,43%	0,97%	0,02%	-0,03%	0,68%	7,81%	0,52%
MERCADO														
POUPANÇA	0,59%	0,50%	0,50%	0,52%	0,55%	0,48%	0,50%	0,47%	0,43%	0,43%	0,41%	0,41%	5,94%	0,06%
CDI	0,89%	0,74%	0,81%	0,70%	0,73%	0,64%	0,68%	0,69%	0,54%	0,61%	0,54%	0,53%	8,41%	0,11%
IFM (índice RiskOffice)	1,26%	1,10%	0,93%	1,56%	1,50%	0,72%	1,43%	0,37%	0,47%	1,10%	0,50%	1,50%	13,16%	0,43%
IBX	7,93%	3,85%	-0,23%	-2,48%	-8,61%	0,88%	3,11%	-0,16%	2,79%	-1,07%	1,16%	4,77%	11,55%	4,15%
IBOVESPA	11,13%	4,34%	-1,98%	-4,17%	-11,86%	-0,25%	3,21%	1,72%	3,71%	-3,56%	0,71%	6,05%	7,39%	5,84%
POUPREV														
Renda fixa	1,31%	1,27%	1,28%	1,71%	1,42%	-0,10%	1,40%	1,33%	1,13%	1,94%	0,72%	1,56%	16,02%	0,52%
Renda variável	7,56%	4,47%	0,03%	-1,10%	-8,35%	2,43%	2,21%	0,21%	1,60%	-0,94%	1,02%	5,19%	14,32%	3,97%
Investimentos Estruturados	0,99%	0,58%	1,61%	0,73%	1,00%	0,50%	0,72%	0,41%	0,71%	0,04%	4,57%	3,40%	16,26%	2,16%
Operações com Particip.	1,22%	1,23%	1,23%	1,08%	0,89%	1,12%	1,24%	1,15%	1,19%	1,26%	1,07%	1,23%	14,83%	0,11%
CARTEIRA GLOBAL	1,91%	1,60%	1,17%	1,38%	0,43%	0,30%	1,46%	1,21%	1,17%	1,60%	0,90%	2,12%	16,34%	0,54%
METAS														
Renda fixa (mista)**	1,26%	1,06%	0,96%	0,96%	0,66%	0,55%	0,97%	0,89%	0,78%	0,97%	0,69%	1,09%	11,39%	0,20%
Renda variável (mista) ***	9,39%	4,22%	-0,77%	-3,00%	-9,77%	0,59%	3,32%	0,76%	3,33%	-1,91%	1,14%	5,45%	12,08%	4,82%
Inv. Estruturados (IFM)	1,26%	1,10%	0,93%	1,56%	1,50%	0,72%	1,43%	0,37%	0,47%	1,10%	0,50%	1,50%	13,16%	0,43%
Op. Particip. (INPC+5%)	0,92%	0,80%	0,59%	1,05%	0,96%	0,67%	0,84%	0,86%	1,04%	1,12%	0,95%	1,15%	11,51%	0,17%
META GLOBAL (INPC + 5% aa)	0,92%	0,80%	0,59%	1,05%	0,96%	0,67%	0,84%	0,86%	1,04%	1,12%	0,95%	1,15%	11,51%	0,17%
Aplicações PGA	0,99%	0,71%	0,78%	0,39%	0,98%	0,49%	0,56%	0,75%	0,33%	0,50%	0,61%	0,34%	7,69%	0,23%
Meta PGA (90% CDI)	0,80%	0,67%	0,73%	0,63%	0,66%	0,58%	0,61%	0,62%	0,49%	0,55%	0,49%	0,48%	7,57%	0,10%

* Desvio padrão dos últimos 12 meses

** $\{33,63\% \times \text{rentabilidade global}\} + \{66,37\% \times \text{CDI} + 0,5\%\}$

*** $\{40\% \times (\text{Ibovespa} + 5\% \text{ ao ano})\} + \{60\% \times \text{IBrX}\}$

Ricardo José Andrade Leite Viana

Dir. Adm. e Finanças

Eliana Aparecida Silva

Presidente