

RENTABILIDADE

Carteira Investimentos PLANO e PGA
Relatório Analítico



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2015

	jan/2015	fev/2015	mar/2015	abr/2015	mai/2015	jun/2015	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
INFLAÇÃO									
INPC	1,48%	1,16%	1,51%	0,71%	0,99%	0,77%	6,80%		
IPCA	1,24%	1,22%	1,32%	0,71%	0,74%	0,79%	6,17%		
IGP-M	0,76%	0,27%	0,98%	1,17%	0,41%	0,67%	4,33%		
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,59%	0,52%	0,63%	0,61%	0,62%	0,68%	3,70%		
CDI	0,93%	0,82%	1,03%	0,95%	0,98%	1,06%	5,91%		
IMA-B	3,12%	0,54%	-0,28%	2,44%	2,57%	-0,27%	8,34%		
IFM (índice RiskOffice)	1,12%	1,59%	2,39%	-0,50%	1,45%	0,12%	6,30%		
IBX	-5,88%	9,33%	-0,50%	9,12%	-5,47%	0,77%	6,43%		
IBOVESPA	-6,20%	9,97%	-0,84%	9,93%	-6,17%	0,61%	6,15%		
MSCI Word (Global) *	-1,65%	14,04%	9,65%	-4,67%	6,24%	-4,79%	18,59%		

CARTEIRA PLANO

	jan/2015	fev/2015	mar/2015	abr/2015	mai/2015	jun/2015	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
POUPREV									
Renda fixa	2,04%	0,81%	0,46%	2,21%	2,09%	0,39%	8,25%		
Renda variável	-6,92%	6,45%	1,04%	5,67%	-3,97%	-0,06%	1,53%		
Investimentos Estruturados	-0,10%	1,57%	-0,19%	0,51%	0,35%	0,48%	2,64%		
Investimentos no Exterior **	-2,65%	12,68%	9,98%	-4,10%	6,16%	-3,78%	18,18%		
Operações com Particip.	1,09%	1,18%	1,25%	1,22%	1,10%	2,67%	8,81%		
CARTEIRA GLOBAL	0,77%	1,60%	0,66%	2,37%	1,24%	0,51%	7,35%		
METAS									
Renda fixa (INPC + 4,5%aa)	1,85%	1,53%	1,88%	1,08%	1,36%	1,14%	9,17%		
Renda variável (Ibovespa)	-6,20%	9,97%	-0,84%	9,93%	-6,17%	0,61%	6,15%		
Inv. Estruturados (IFM)	1,12%	1,59%	2,39%	-0,50%	1,45%	0,12%	6,30%		
Investimentos no Exterior (MSCI)	-1,65%	14,04%	9,65%	-4,67%	6,24%	-4,79%	18,59%		
Op. Particip. (INPC + 4,5%)	1,85%	1,53%	1,88%	1,08%	1,36%	1,14%	9,17%		
META GLOBAL (INPC + 4,5% aa)	1,85%	1,53%	1,88%	1,08%	1,36%	1,14%	9,17%		

CARTEIRA PGA

	jan/2015	fev/2015	mar/2015	abr/2015	mai/2015	jun/2015	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Aplicações PGA	0,89%	0,83%	0,99%	1,01%	1,06%	1,01%	5,93%		
Meta PGA (95% CDI + 5% IMAB)	1,04%	0,81%	0,96%	1,02%	1,06%	0,99%	6,03%		

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

	jan/2015	fev/2015	mar/2015	abr/2015	mai/2015	jun/2015	1º Sem	últ. 12m	últ. 24m
Rent. bruta operações c/ Particip.	1,33%	1,28%	1,46%	1,38%	1,32%	1,44%	8,50%		
Rentabilidade Total bruta	0,82%	1,57%	0,68%	2,32%	1,33%	0,40%	7,32%		
Rentabilidade Total líquida	0,77%	1,60%	0,66%	2,37%	1,24%	0,51%	7,35%		

* 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).

RENTABILIDADE

Carteira Investimentos PLANO e PGA
Relatório Analítico



POUPREV/DIRAF

Ref.: dez/2015

	jul/2015	ago/2015	set/2015	out/2015	nov/2015	dez/2015	2015	últ. 24m	últ. 36m
INFLAÇÃO									
INPC	0,58%	0,25%	0,51%	0,77%	1,11%	0,90%	11,28%	18,21%	24,78%
IPCA	0,62%	0,22%	0,54%	0,82%	1,01%	0,96%	10,67%	17,77%	24,73%
IGP-M	0,69%	0,28%	0,95%	1,89%	1,52%	0,49%	10,54%	14,61%	20,94%
ÍNDICES DE MERCADO									
POUPANÇA	0,73%	0,69%	0,69%	0,68%	0,63%	0,73%	8,08%	15,73%	22,46%
CDI	1,18%	1,11%	1,11%	1,11%	1,06%	1,16%	13,24%	25,47%	35,57%
IMA-B	-0,73%	-3,11%	-0,68%	2,58%	1,03%	1,52%	8,89%	24,72%	12,22%
IFM (índice RiskOffice)	3,09%	-0,36%	0,90%	1,20%	1,57%	0,93%	14,30%	22,46%	31,66%
IBX	-3,44%	-8,25%	-3,10%	1,36%	-1,66%	-3,79%	-12,38%	-14,84%	-17,51%
IBOVESPA	-4,17%	-8,33%	-3,36%	1,80%	-1,63%	-3,92%	-13,30%	-15,84%	-28,88%
MSCI Word (Global) *	11,28%	0,13%	4,74%	4,74%	-0,88%	-0,48%	42,99%	66,86%	137,38%

CARTEIRA PLANO

	jul/2015	ago/2015	set/2015	out/2015	nov/2015	dez/2015	2015	últ. 24m	últ. 36m
POUPREV									
Renda fixa	-0,15%	-1,82%	-0,22%	1,85%	1,21%	1,53%	10,82%	27,25%	34,47%
Renda variável	-2,52%	-6,60%	-1,94%	0,80%	-0,72%	-2,92%	-11,94%	-14,87%	-17,57%
Investimentos Estruturados	1,40%	0,91%	-0,08%	-0,62%	1,99%	8,34%	15,23%	29,82%	23,38%
Investimentos no Exterior **	7,79%	0,01%	3,09%	7,36%	0,91%	0,65%	43,21%	68,75%	68,75%
Operações com Particip.	1,32%	1,34%	1,35%	1,28%	1,29%	1,29%	17,66%	33,16%	51,10%
CARTEIRA GLOBAL	-0,12%	-1,34%	-0,67%	1,67%	1,17%	1,70%	9,92%	23,45%	29,56%
METAS									
Renda fixa (INPC + 4,5%aa)	0,95%	0,62%	0,88%	1,14%	1,48%	1,27%	16,27%	28,02%	40,56%
Renda variável (Ibovespa)	-4,17%	-8,33%	-3,36%	1,80%	-1,63%	-3,92%	-13,30%	-15,82%	-25,65%
Inv. Estruturados (IFM)	3,09%	-0,36%	0,90%	1,20%	1,57%	0,93%	14,30%	22,46%	31,66%
Investimentos no Exterior (MSCI)	11,28%	0,13%	4,74%	4,74%	-0,88%	-0,48%	42,99%	66,86%	66,86%
Op. Particip. (INPC + 4,5%)	0,95%	0,62%	0,88%	1,14%	1,48%	1,27%	16,27%	33,42%	53,51%
META GLOBAL (INPC + 4,5% aa)	0,95%	0,62%	0,88%	1,14%	1,48%	1,27%	16,27%	29,08%	42,41%

CARTEIRA PGA

Aplicações PGA	1,07%	0,98%	1,01%	1,15%	0,98%	1,25%	12,94%	25,88%	36,00%
Meta PGA (95% CDI + 5% IMAB)	1,08%	0,90%	1,02%	1,18%	1,06%	1,18%	13,03%	25,46%	35,56%

COTA BRUTA X LÍQUIDA ***

Rent. bruta operações c/ Particip.	1,39%	1,39%	1,38%	1,34%	1,38%	1,36%	17,75%	38,43%	62,61%
Rentabilidade Total bruta	-0,11%	-1,83%	-0,17%	1,68%	1,18%	1,70%	9,93%	23,86%	29,99%
Rentabilidade Total Líquida	-0,12%	-1,34%	-0,67%	1,67%	1,17%	1,70%	9,92%	23,45%	29,56%

* 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).