

Resumo  
do **Relatório Anual**  
de Informações  
**Plano de Gestão**  
**Administrativa - PGA**



*Fases  
da vida*

# Demonstrativo de Investimentos 2016

## Plano de Gestão Administrativa - PGA

No **Quadro I**, a seguir, é apresentado o comparativo da posição dos investimentos ao final dos exercícios acima mencionados. Em linhas gerais, o quadro demonstra a formação do patrimônio, sua distribuição e o limite máximo de enquadramento, de acordo com a legislação vigente e a Política de Investimentos da Prevdada.

Quadro I - Distribuição, Evolução, Composição, e Limites dos Investimentos						
Composição dos Segmentos	Patrimônio em 31/12/2015		Patrimônio em 31/12/2016		Limite de Enquadramento	
	Valor (R\$)	Distribuição	Valor (R\$)	Distribuição	Resolução	Política
<b>Patrimônio Total</b>	<b>17.392.138,33</b>	<b>100,00%</b>	<b>22.904.414,30</b>	<b>97,80%</b>	<b>3792/2009</b>	
<b>Titulos Públicos</b>	<b>10.368.717,53</b>	<b>59,62%</b>	<b>18.101.634,63</b>	<b>79,03%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>
Notas Tesouro - NTN	10.368.717,53	59,62%	18.101.634,63	79,03%	100,00%	100,00%
<b>Titulos Privados</b>	<b>1.443.488,23</b>	<b>8,30%</b>	<b>1.542.746,39</b>	<b>6,74%</b>	<b>80,00%</b>	<b>80,00%</b>
Letra Financeira Banco Itau	1.443.488,23	8,30%	1.542.746,39	6,74%	20,00%	20,00%
<b>Fundos Renda Fixa</b>	<b>5.579.932,57</b>	<b>32,08%</b>	<b>2.756.142,51</b>	<b>12,03%</b>	<b>80,00%</b>	<b>80,00%</b>
Fundo HSBC Ref. DI Executivo	1.519.915,11	8,74%	648.797,09	2,83%	80,00%	80,00%
Fundo Rio Bravo Crédito Privado	1.334.671,93	7,67%	637.601,87	2,78%	80,00%	80,00%
Fundo Safra Capital Market FIC de FI	1.196.698,64	6,88%	376.744,34	1,64%	80,00%	80,00%
Fundo Santander institucional FIC de FI	1.291.446,00	7,43%	627.337,18	2,74%	80,00%	80,00%
Fundo Pactual Emissões Primárias	237.200,89	1,36%	129.742,52	0,57%	80,00%	80,00%
Fundo BNP Paribas Match DI	-	0,00%	335.919,51	1,47%	80,00%	80,00%
<b>Fundos Estruturados</b>	<b>-</b>	<b>0,00%</b>	<b>503.890,77</b>	<b>2,20%</b>	<b>20,00%</b>	<b>20,00%</b>
Fundo Ibiuna Hedge FIP	-	0,00%	256.905,94	1,12%	20,00%	20,00%
Fundo Maua FIC de FIM	-	0,00%	246.984,83	1,08%	20,00%	20,00%

Conforme demonstrado na tabela acima, a Prevdada cumpriu os limites de enquadramento previstos na legislação e na Política de Investimentos da Entidade. A principal alteração na gestão de ativos deste Plano de Gestão Administrativa ocorreu com a entrada dos fundos estruturados, mais especificamente na modalidade de fundos multimercados, em dezembro de 2016. A fim de superar a meta de rentabilidade deste plano, correspondente à variação do índice INPC + 5,5% a.a., a Prevdada teve que buscar ativos com perfil de risco mais elevado, caso contrário, superar a meta de rentabilidade seria praticamente impossível.

No **Quadro II**, a seguir, é apresentado um comparativo da rentabilidade de todos os segmentos da carteira da Prevdada, referentes aos exercícios de 2015 e 2016. Este quadro demonstra as diferenças em relação à meta de rentabilidade de cada segmento.

Quadro II - Rentabilidade (%)	2015			2016		
	Carteira	Meta	Diferença	Carteira	Meta	Diferença
Rentabilidade Global	15,78	17,40	(1,62)	14,05	12,44	1,61
Investimentos Estruturados *	0,00	0,00	0,00	2,10	0,43	1,67
Renda Fixa	15,78	17,40	(1,62)	14,04	12,44	1,60

\* Alocação feita em dezembro.

Obs.: Na coluna "Diferença" estão apuradas as variações entre as carteiras e suas respectivas metas no ano.

O Plano de Gestão Administrativa superou a meta de rentabilidade em todos os segmentos. Cabe destacar que a meta e a rentabilidade auferidas pelo segmento de investimentos estruturados correspondem à variação de um único mês, pois a alocação em fundos multimercados foi realizada em dezembro de 2016.

O **Quadro III**, a seguir, demonstra o valor alocado em fundos de investimentos em 2016, meio pelo qual a Prevdada distribui os recursos entre os gestores terceirizados. Portanto, o quadro registra a participação total do patrimônio do Plano de Gestão Administrativa, no fechamento do exercício, em relação ao que é gerido por terceiros.

<b>Quadro III - Gestão Terceirizada (Distribuição dos Recursos entre Gestores) Plano de Gestão Administrativa</b>				
<b>Composição dos Segmentos</b>	<b>Gestão Terceirizada</b>		<b>Patrimônio Total</b>	
	<b>Valor (R\$)</b>	<b>Distribuição</b>	<b>Valor (R\$)</b>	<b>Distribuição</b>
<b>Total</b>	<b>3.260.033,28</b>		<b>22.904.414,30</b>	
<b>Total da Gestão Terceirizada</b>	<b>3.260.033,28</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.756.142,51</b>	<b>12,03%</b>
<b>Fundos Renda Fixa</b>	<b>2.756.142,51</b>	<b>84,54%</b>	<b>2.756.142,51</b>	<b>12,03%</b>
Fundo HSBC Ref. DI Executivo	648.797,09	19,90%	648.797,09	2,83%
Fundo Rio Bravo Crédito Privado	637.601,87	19,56%	637.601,87	2,78%
Fundo Safra Capital Market FIC de FI	376.744,34	11,56%	376.744,34	1,64%
Fundo Santander institucional FIC de FI	627.337,18	19,24%	627.337,18	2,74%
Fundo Pactual Emissões Primárias	129.742,52	3,98%	129.742,52	0,57%
Fundo BNP Paribas Match DI	335.919,51	10,30%	335.919,51	1,47%
<b>Fundos Estruturados</b>	<b>503.890,77</b>	<b>15,46%</b>	<b>503.890,77</b>	<b>2,20%</b>
Fundo Ibiuna Hedge FIP	256.905,94	7,88%	256.905,94	1,12%
Fundo Maua FIC de FIM	246.984,83	7,58%	246.984,83	1,08%

No **Quadro IV**, a seguir, observa-se o custo com a gestão terceirizada e com o Programa de Investimentos da Prevdta, inclusive o rateio administrativo no ano de 2016.

<b>Quadro IV - Custo com Administração de Recursos Plano ADM</b>						
<b>Instituição</b>	<b>Administração</b>	<b>Auditoria</b>	<b>Custódia</b>	<b>CETIP</b>	<b>ANDIMA</b>	<b>Total</b>
Fundo BNP Paribas Match DI	947,29	0,00	115,42	48,28	0,00	1.111,00
Fundo Pactual Emissões Primárias	719,68	0,00	28,82	17,88	14,95	781,33
Fundo Ibiuna Hedge FIP	13,31	0,30	0,00	0,00	0,02	13,62
Fundo HSBC Ref. DI Executivo	4.134,09	3,36	601,88	109,61	0,77	4.849,71
Fundo Rio Bravo Créd. Privado	2.451,37	7,65	3,68	20,57	4,71	2.487,98
Fundo Safra Capital FIC de FI	1.096,19	0,48	18,26	1,55	0,49	1.116,97
Fundo Santander FIC FI	3.306,23	46,30	3,17	206,77	28,58	3.591,03
<b>TOTAL</b>	<b>12.668,15</b>	<b>58,08</b>	<b>771,23</b>	<b>404,67</b>	<b>49,52</b>	<b>13.951,65</b>

Gestão de Risco - A Prevdta possui contrato, junto a seu agente custodiante, para o serviço de análise e acompanhamento de enquadramento legal dos ativos. Conforme disposto na Política de Investimentos, a Prevdta avalia o risco de suas carteiras próprias, fundos de investimentos e patrimônio global com base no método Value at Risk - VaR, realizado por empresa de consultoria.

No quadro abaixo elencamos o nome do Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado - AETQ pela gestão dos recursos, gestores de recursos externos, custodiante, e auditores independentes.

<b>Informações sobre o Administrador Tecnicamente Qualificado da Prevdata</b>
Nome: Carlos Eduardo Gomes Villar
Cargo: Diretor de Administração e Finanças
Telefone para contato: (21) 2112-7676
E-mail: prevdata@prevdata.org.br
<b>Informações sobre os Administradores da Gestão Terceirizada</b>
<b>Banco BTG Pactual Serviços Financeiros S/A DTVM - Telefone (21) 3262-9237 - Joaquim Baiao</b>
Praia de Botafogo, 501 / 5º andar - Rio de Janeiro   CNPJ - 59.281.253/0001-23   E-mail: priscila.mendes@btgpactual.com
<b>Banco Santander Brasil SA - Telefone (11) 3553-6398 - Giovana Furiati</b>
Avenida Juscelino Kubitschek, 2235 - 8º andar - Est. 440   CNPJ - 90.400.888/0001-42   E-mail: gmendonca@santander.com.br
<b>Banco BNP Paribas - Danielle Rebotinni - Tel.: (11) 3049-2852</b>
Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 510, 14º andar - São Paulo - SP   CNPJ - 01.522.368/0001-82   E-Mail: Danielle.Rebotini@br.bnpparibas.com
<b>HSBC BANK Brasil S.A. - Banco Múltiplo - Telefone (21) 3043-2395 - João Carlos</b>
Travessa Oliveira Bello, 34 - 4º andar - Curitiba - Parana   CNPJ - 01.701.201/0001-89   E-mail: joao.c.rocha@hsbc.com.br
<b>Icatu Hartford Administração de Recursos LTDA - Telefone (21) 3824-7172 - Maira Araujo</b>
Praça 22 de Abril, 36 (parte) - Rio de Janeiro   E-mail: mcompasso@icatu Vanguarda.com.br
<b>Kinea Investimentos Ltda - Telefone (11) 3073-8700 - Cesar Alves</b>
Rua Minas da Prata, n.º 30, 4º andar, São Paulo - SP   CNPJ - 08.604.187/0001-44   E-mail: cesar.alves@itau-unibanco.com.br
<b>Maua Investimentos LTDA - Marcos Colombo - (11) 2102-0710</b>
Rua Joaquim Floriano, 413, 16º andar - São Paulo - SP   CNPJ - 11.626.160/0001-67   E-mail: mcolombo@mauacapital.com
<b>Rio Bravo Investimentos DTVM Ltda Telefone (21) 2107-6687 - Sheila</b>
Av. Chedid Jafet, n.º 222 Bloco B - 3º andar - São Paulo - SP   CNPJ - 72.600.026/0001-81   E-mail: scheila.lofrano@riobravo.com.br
<b>SAFRA Asset Management LTDA - Telefone (11) 3175-7757 - Vagner</b>
Avenida Paulista, n.º 2100, Cidade e Estado de São Paulo   CNPJ: 62.180.047/0001-31   E-mail: wagner.kladt@safra.com.br
<b>Responsável pela Auditoria Externa</b>
<b>Grand Thornton Auditores Independentes - Telefone para contato: (21) 2292-5036</b>
CNPJ/MF: 10.830.108/0001-65   E-mail: ana.areosa@br.gt.com
<b>Responsável pela Custódia Centralizada</b>
<b>Banco Bradesco S/A</b>
CNPJ 60.746.948/0001-12   Endereço: Cidade de Deus, Prédio Amarelo Velho, 3º andar, Bairro Vila Yara   São Paulo, SP.
Responsável: Aurelio Fagundes   E-mail: 4010.aurelio@bradesco.com.br   Tel.: (0xx11) 3684-9229

Rio de Janeiro, 28 de Abril de 2017.

Ary Follain Junior  
Diretor de Atendimento e Segurança

Carlos Eduardo Gomes Villar  
Diretor de Administração e Finanças

Paulo Sérgio Carmo dos Santos  
Presidente Executivo

