

Relatório de Investimentos

Janeiro – 2020

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

1

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	712.019.778,66	70,9%	331.728.532,13	53,42%	35.898.522,06	92,08%	1.079.646.832,85	64,89%
ESTRUTURADOS	126.173.770,26	12,57%	73.919.036,57	11,90%	2.915.808,31	7,48%	203.008.615,14	12,20%
RENTA VARIÁVEL	132.186.596,07	13,17%	183.687.732,61	29,58%	173.917,48	0,45%	316.048.246,16	18,99%
EXTERIOR	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
IMOBILIÁRIOS	4.405.650,12	0,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	4.405.650,12	0,26%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	29.085.889,98	2,90%	31.680.870,08	5,10%	0,00	0,00%	60.766.760,06	3,65%
TOTAL	1.003.871.685,09	100,0%	621.016.171,39	100,0%	38.988.247,85	100,0%	1.663.876.104,33	100,0%
PL MÊS ANTERIOR	995.249.184,62		613.551.082,12		38.135.260,09		1.646.935.526,83	

Plano PRV - Renda Fixa				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	4,62%	4,62%	168.909,05	0,02%
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,30%	-16,30%	154,43	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,49%	9.822.220,81	0,98%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,46%	11.804.162,79	1,18%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,42%	15.574.773,75	1,55%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,46%	18.210.832,71	1,81%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,36%	16.657.042,87	1,66%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,37%	16.138.396,15	1,61%
Letra Finan.	1,36%	1,36%	37.965.233,72	3,78%
Título Público - NTN-B	1,32%	1,32%	585.678.052,38	58,34%
RENTA FIXA	1,21%	1,21%	712.019.778,66	70,93%
META ATUARIAL (INPC+ 5,10% a.a.)	0,61%	0,61%		

PREVDATA - Sociedade de Previdência Complementar da Dataprev - CNPJ 30.258.057/0001-56

Av. Rio Branco, 108 / 12º andar

Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br

Plano CV - Renda Fixa				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,30%	-16,30%	88,25	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,49%	7.987.300,44	1,29%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,46%	33.782.259,95	5,44%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,36%	35.234.229,77	5,67%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,46%	40.914.022,36	6,59%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,42%	35.817.317,16	5,77%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,37%	34.904.817,89	5,62%
Letra Finan.	1,28%	1,28%	15.058.929,30	2,42%
Título Público - NTN-B	0,74%	0,74%	128.029.567,01	20,62%
RENDA FIXA	0,58%	0,58%	331.728.532,13	53,42%
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,59%		

PGA - Renda Fixa				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,32%	-16,32%	22,05	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,49%	566.666,59	1,45%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,46%	3.274.849,76	8,40%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,42%	3.710.705,20	9,52%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,46%	2.906.153,65	7,45%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,36%	2.890.532,98	7,41%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,37%	3.137.448,35	8,05%
Título Público - NTN-B	1,11%	1,11%	19.412.143,48	49,79%
RENDA FIXA	0,79%	0,79%	35.898.522,06	92,08%
META ATUARIAL (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,56%		

Plano PRV - Renda Variável					
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	2,34%	23.843.511,74	2,38%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	6,08%	40.326.622,57	4,02%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	-2,72%	-2,72%	16.971.785,02	1,69%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	-0,98%	-0,98%	32.284.760,69	3,22%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	0,95%	0,95%	6.312.083,15	0,63%
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livres	0,79%	0,79%	12.447.832,90	1,24%
RENDA VARIÁVEL		1,71%	1,71%	132.186.596,07	13,17%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-1,63%		
META ATUARIAL (INPC + 5,10%)		0,61%	0,61%	-	-

Plano CV - Renda Variável					
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Janeiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livre	0,79%	0,79%	8.320.048,95	1,34%
OCEANA VALOR FIC AÇÕES	Índice Ativo	-2,02%	-2,02%	14.752.445,14	2,38%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	0,95%	0,95%	9.436.646,14	1,52%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	2,34%	29.115.515,87	4,69%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	3,18%	3,18%	23.735.778,70	3,82%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	6,08%	62.537.754,65	10,07%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	-2,72%	-2,72%	22.139.421,79	3,57%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	-0,98%	-0,98%	13.650.121,37	2,20%
RENDA VARIÁVEL		2,27%	2,27%	183.687.732,61	29,58%
IBOVESPA		-1,63%	-1,63%		
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)		-1,47%	-1,47%		
META ATUARIAL (INPC + 4,90%)		0,59%	0,59%	-	-

Plano PGA - Renda Variável					
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	2,34%	173.917,48	0,02%
REDA VARIÁVEL		2,34%	2,34%	173.917,48	100,00%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-1,63%	-	-
META ATUARIAL (INPC + 4,50%)		0,56%	0,56%	-	-

Plano PRV - Investimentos Estruturados				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,27%	3,27%	7.814.938,24	0,78%
FIP Kinea	-10,51%	-10,51%	5.069.490,35	0,50%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	-1,13%	14.916.411,98	1,49%
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	0,02%	1.660.388,07	0,17%
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	0,18%	17.671.517,80	1,76%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	1,65%	24.936.885,98	2,48%
FMM BAHIA MARAÚ	-0,18%	-0,18%	11.158.043,69	1,11%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,18%	16.091.780,54	1,60%
FMM AZ QUEST Multi	0,75%	0,75%	16.904.807,06	1,68%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-0,78%	3.075.862,80	0,31%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,04%	0,04%	6.873.643,75	0,68%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	0,57%	0,57%	126.173.770,26	12,57%
META ATUARIAL (INPC + 5,10% a.a.)	0,61%	0,61%		

Plano CV - Investimentos Estruturados				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,27%	3,27%	2.604.979,43	0,42%
FIP Kinea	-10,51%	-10,51%	2.534.728,52	0,41%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	-1,13%	2.981.919,12	0,48%
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	0,02%	996.232,82	0,16%
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	0,18%	13.953.843,36	2,25%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	1,65%	17.560.337,64	2,83%
FMM BAHIA MARAÚ	-0,18%	-0,18%	9.959.069,55	1,60%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,18%	5.879.689,04	0,95%
FMM AZ QUEST MULTI FIM	0,75%	0,75%	12.491.100,22	2,01%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-0,78%	4.957.136,87	0,80%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,54%	0,54%	73.919.036,57	11,90%
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,59%		100,00%

Plano PGA - Investimentos Estruturados				
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	0,18%	1.421.963,88	3,65%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	1,65%	1.037.076,44	2,66%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,18%	206.304,88	0,53%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-0,78%	250.463,11	0,64%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,59%	0,59%	2.915.808,31	7,48%
META GESTÃO (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,56%	-	-

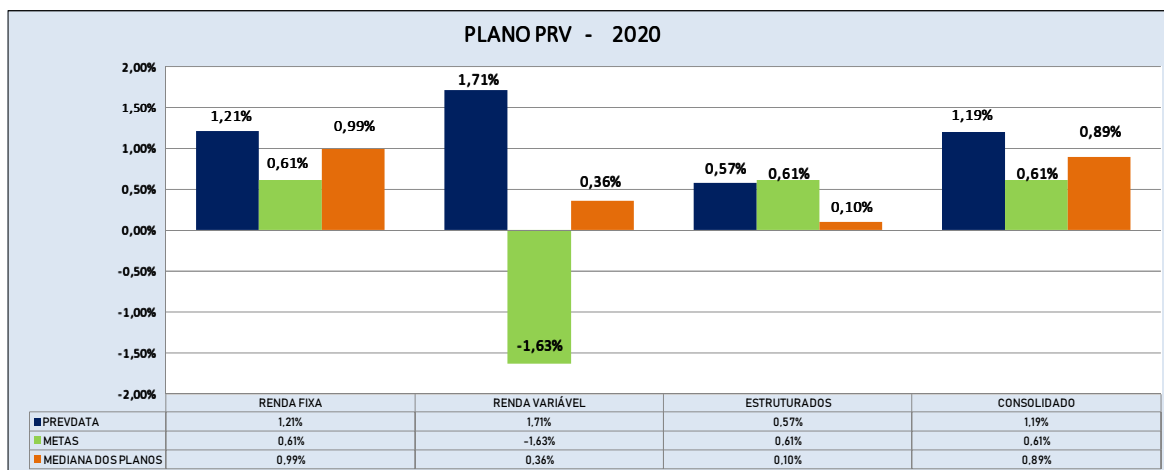
✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/20	2020
CONSOLIDADO	1,19%	1,19%
RENTA FIXA	1,21%	1,21%
RENTA VARIÁVEL	1,71%	1,71%
IMOBILIÁRIO	0,56%	0,56%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,19%
ESTRUTURADOS	0,57%	0,57%
CDI	0,38%	0,38%
IBOVESPA	-1,63%	-1,63%
META ATUARIAL (INPC + 5,10%)	0,61%	0,61%

PLANO CV	01/20	2020
CONSOLIDADO	1,10%	1,10%
RENTA FIXA	0,58%	0,58%
RENTA VARIÁVEL	2,27%	2,27%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,19%
ESTRUTURADOS	0,54%	0,54%
META ATUARIAL (INPC + 4,90%)	0,59%	0,59%

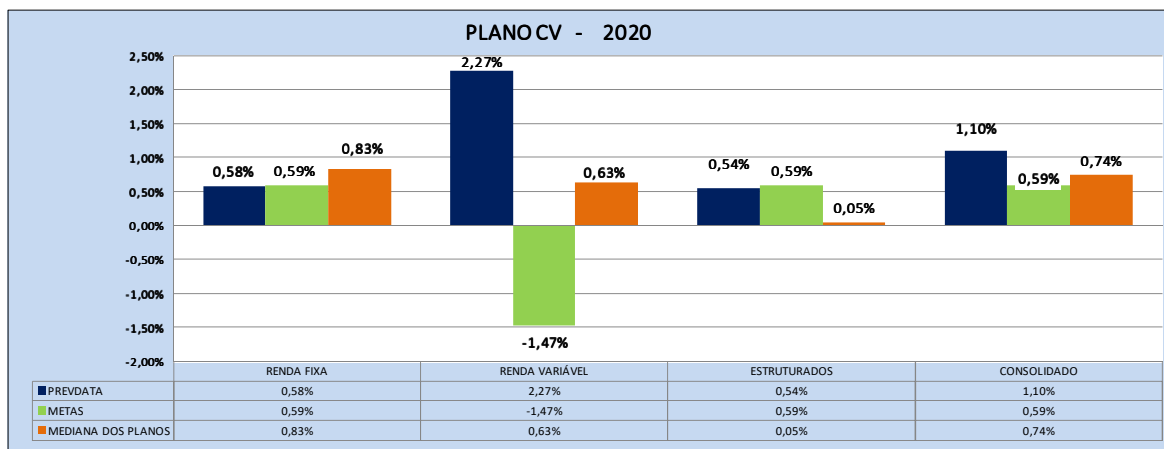
PLANO PGA	01/20	2020
CONSOLIDADO	0,78%	0,78%
RENTA FIXA	0,79%	0,79%
RENTA VARIÁVEL	2,34%	2,34%
ESTRUTURADOS	0,59%	0,59%
TX. GESTÃO (INPC + 4,50%)	0,56%	0,56%

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV:



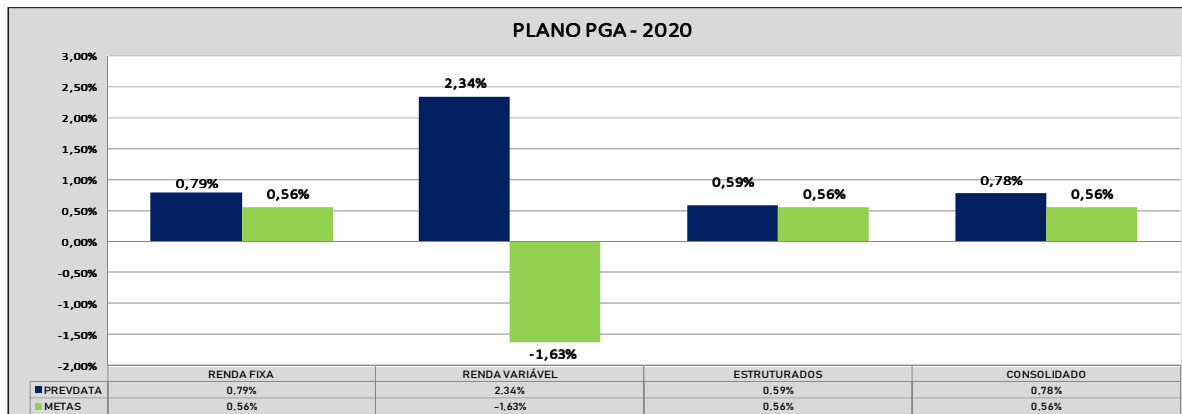
Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano CV:



Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



* Renda Variável - início em agosto de 2019

PREVDATA - Sociedade de Previdência Complementar da Dataprev - CNPJ 30.258.057/0001-56

Av. Rio Branco, 108 / 12º andar

Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

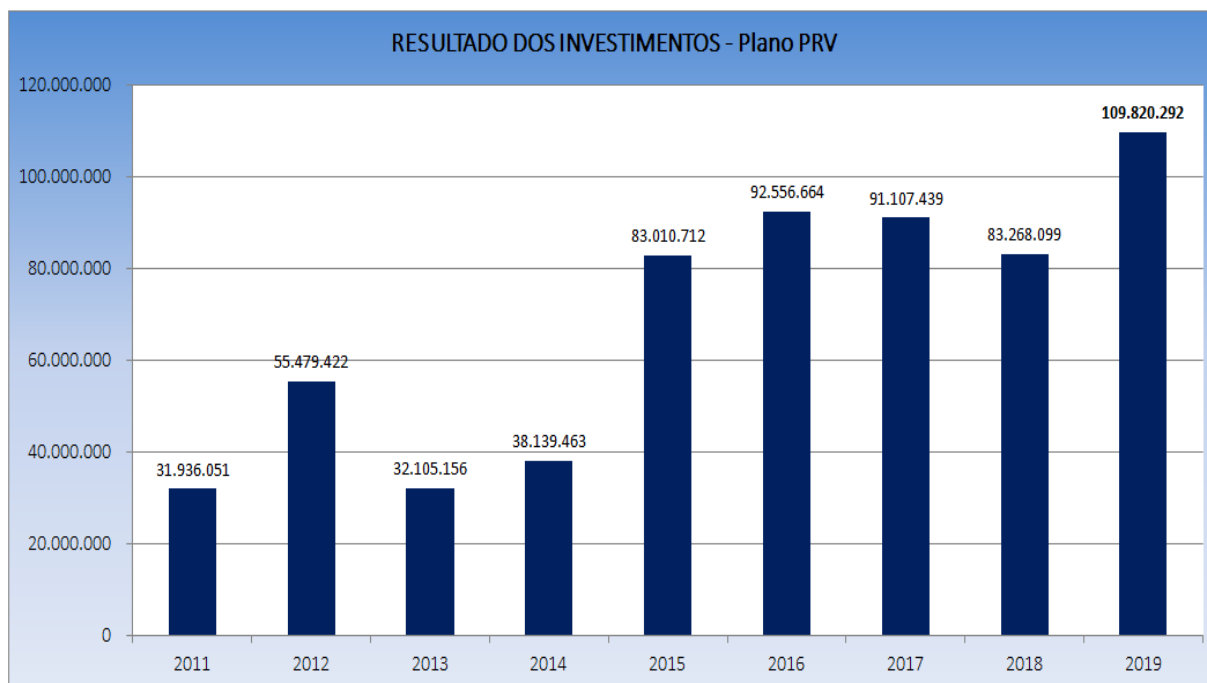
www.prevdata.org.br

✓ Demonstração de Resultado até **DEZ/19:**

DEMONSTRAÇÃO CONTÁBIL -		PLANO PRV	DEMONSTRAÇÃO ATIVO LÍQUIDO	
Exercício	Superávit/Déficit	Resultado Acum.	Ajuste Precificação NTN-B	Resultado Final
2014	-28.737.663,80	-39.787.717,78	10.110.893,57	-29.676.824,21
2015	64.010.415,65	24.222.697,67	26.381.948,14	50.604.645,81
2016	-47.711.421,28	-23.488.723,61	20.573.580,72	-2.915.142,89
2017	-3.947.881,55	-27.436.605,16	20.345.417,20	-7.091.187,96
2018	-13.256.997,97	-40.693.603,13	32.723.638,91	-7.969.964,22
2019	16.004.509,22	-24.689.093,91	44.096.364,07	19.407.270,16

Considerando as regras de ajuste de precificação, conforme estabelecido na Instrução Previc 19, de 04/02/2015, que permitem utilizarmos o montante apurado com a diferença entre o valor dos títulos públicos federais – NTN-B, atrelados ao índice de preços classificados na categoria títulos mantidos até o vencimento e o mesmo título calculado considerando a taxa de juros real utilizada nas provisões.

Do déficit técnico atuarial de **R\$ 24.689.093** deduzimos o valor de **R\$ 44.096.364**, referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como superávit técnico remanescente a quantia de **R\$ 19.407.270**, sem considerar os demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 2.721.970**.



RESULTADO DO INVESTIMENTO = RECEITAS - DESPESAS DE INVEST. - DESPESAS DE CUSTEIO - FUNDOS

PREVDATA - Sociedade de Previdência Complementar da Dataprev - CNPJ 30.258.057/0001-56

Av. Rio Branco, 108 / 12º andar

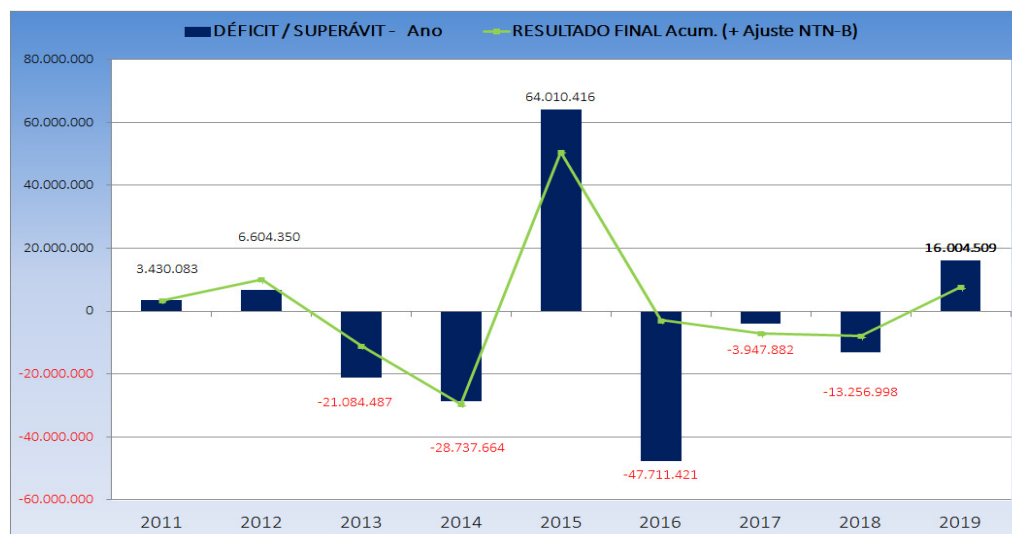
Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br



✓ RENTABILIDADE ACUMULADA DOS PLANOS:

PLANO PRV	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	0,61%	10,23%	9,12%	7,94%	12,76%	17,73%	73,40%
CONSOLIDADO	1,19%	12,72%	10,34%	12,39%	14,45%	14,73%	85,75%
RENTA FIXA	1,21%	9,58%	9,65%	9,69%	14,02%	18,36%	80,02%
RENTA VARIÁVEL	1,71%	40,91%	28,96%	49,39%	26,93%	-16,04%	194,22%
IMOBILIÁRIO	0,56%	7,85%	30,10%	10,87%	8,98%	33,14%	126,96%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	11,09%	12,66%	10,30%	16,93%	19,04%	94,42%
ESTRUTURADOS	0,57%	8,11%	8,05%	39,50%	15,33%	-15,92%	58,92%

PLANO CV	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	0,59%	10,23%	9,12%	7,88%	12,66%	17,67%	73,04%
CONSOLIDADO	1,10%	16,33%	10,04%	16,19%	18,01%	8,01%	91,66%
RENTA FIXA	0,58%	9,35%	8,38%	11,17%	16,69%	23,55%	91,06%
RENTA VARIÁVEL	2,27%	41,71%	21,58%	35,60%	24,87%	-8,60%	172,68%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	11,15%	12,50%	10,16%	16,74%	18,98%	93,60%
ESTRUTURADOS	0,54%	8,23%	5,59%	32,42%	18,52%	-8,23%	65,50%

PLANO PGA	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	0,56%	9,71%	8,61%	7,68%	12,44%	17,40%	70,30%
CONSOLIDADO	0,78%	8,99%	8,21%	10,11%	14,05%	15,78%	72,81%
RENTA FIXA	0,79%	8,27%	8,59%	9,92%	14,04%	15,78%	71,97%
**RENTA VARIÁVEL	2,34%	19,37%	-	-	-	-	22,16%
* ESTRUTURADOS	0,59%	11,98%	4,55%	18,98%	2,10%	-	43,07%

ÍNDICES	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
CDI	0,38%	5,95%	6,42%	9,93%	14,00%	13,24%	60,61%
IBOVESPA	-1,63%	31,59%	15,04%	26,86%	38,94%	-13,31%	127,55%
INPC	0,19%	4,48%	3,43%	2,07%	6,58%	11,24%	31,02%
IPCA	0,21%	4,31%	3,75%	2,95%	6,29%	10,67%	31,32%
SELIC	0,38%	5,96%	6,43%	9,94%	14,02%	13,27%	60,73%

Obs.: *O segmento de Investimentos Estruturados no Plano PGA, teve início em Dez/2016 e Renda Variável em Ago/2019

PREVDATA - Sociedade de Previdência Complementar da Dataprev - CNPJ 30.258.057/0001-56

Av. Rio Branco, 108 / 12º andar

Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br