

Relatório de Investimentos

Fevereiro – 2020

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	709.969.908,72	71,6%	332.579.456,17	54,55%	36.100.442,47	92,11%	1.078.649.807,36	65,74%
ESTRUTURADOS	126.061.863,60	12,71%	73.994.997,91	12,14%	2.929.558,88	7,47%	202.986.420,39	12,37%
RENTA VARIÁVEL	122.558.262,78	12,36%	171.256.437,55	28,09%	163.786,10	0,42%	293.978.486,43	17,92%
EXTERIOR	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
IMOBILIÁRIOS	4.395.023,42	0,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	4.395.023,42	0,27%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	28.859.624,32	2,91%	31.803.874,22	5,22%	0,00	0,00%	60.663.498,54	3,70%
TOTAL	991.844.682,84	100,0%	609.634.765,85	100,0%	39.193.787,45	100,0%	1.640.673.236,14	100,0%
PL MÊS ANTERIOR	1.003.871.685,09		621.016.171,39		38.988.247,85		1.663.876.104,33	

Plano PRV - Renda Fixa					
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	4,62%	3,84%	8,64%	175.396,17	0,02%
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,30%	-10,58%	-25,16%	138,09	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,37%	0,86%	9.858.497,76	0,99%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	0,71%	22.144.055,04	2,23%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,29%	0,71%	15.620.010,50	1,57%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,26%	0,72%	10.801.493,62	1,09%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,64%	16.703.867,15	1,68%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,29%	0,66%	16.184.554,90	1,63%
Letra Finan.	1,36%	0,54%	1,91%	38.171.919,18	3,85%
Título Público - NTN-B	1,32%	0,54%	1,87%	580.309.976,31	58,51%
RENTA FIXA	1,21%	0,51%	1,72%	709.969.908,72	71,58%
META ATUARIAL (INPC+ 5,10% a.a.)	0,61%	0,59%	1,20%		

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 Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,30%	-10,58%	-25,16%	78,91	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,37%	0,86%	8.016.800,37	1,32%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,26%	0,72%	39.677.668,70	6,51%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,64%	35.333.276,04	5,80%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	0,71%	37.565.136,64	6,16%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,29%	0,71%	35.921.348,15	5,89%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,29%	0,66%	35.004.652,03	5,74%
Letra Finan.	1,28%	0,54%	1,83%	15.139.906,16	2,48%
Título Público - NTN-B	0,74%	0,53%	1,28%	125.920.589,17	20,66%
RENTA FIXA	0,58%	0,39%	0,97%	332.579.456,17	54,55%
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,57%	1,16%		

PGA - Renda Fixa					
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-16,32%	-10,57%	-25,16%	19,72	0,00%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,49%	0,37%	0,86%	568.759,49	1,45%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	0,71%	3.283.150,89	8,38%
Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	0,42%	0,29%	0,71%	3.020.520,31	7,71%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,26%	0,72%	2.913.673,24	7,43%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,64%	4.050.821,65	10,34%
Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP	0,37%	0,29%	0,66%	3.146.422,01	8,03%
Título Público - NTN-B	1,11%	0,52%	1,64%	19.117.075,16	48,78%
RENTA FIXA	0,79%	0,40%	1,19%	36.100.442,47	92,11%
META ATUARIAL (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,54%	1,10%		

Plano PRV - Renda Variável						
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	-5,83%	-3,63%	22.454.532,86	2,26%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	-5,73%	0,00%	38.015.793,39	3,83%
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	-2,72%	-8,40%	-10,89%	15.545.309,08	1,57%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	-0,98%	-8,98%	-9,87%	29.386.311,97	2,96%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	0,95%	-9,52%	-8,66%	5.711.298,81	0,58%
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livres	0,79%	-8,06%	-7,33%	11.445.016,67	1,15%
RENDA VARIÁVEL		1,71%	-7,28%	-5,70%	122.558.262,78	12,36%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-8,43%	-9,92%		
META ATUARIAL (INPC + 5,10%)		0,61%	0,59%	1,20%	-	-

Plano CV - Renda Variável						
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livre	0,79%	-8,06%	-7,33%	7.649.773,23	1,25%
OCEANA VALOR FIC AÇÕES	Índice Ativo	-2,02%	-7,47%	-9,34%	13.650.846,61	2,24%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	0,95%	-9,52%	-8,66%	8.538.465,76	1,40%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	-5,83%	-3,63%	27.419.421,89	4,50%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	3,18%	-5,88%	-2,89%	22.340.512,27	3,66%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	-5,73%	0,00%	58.954.164,96	9,67%
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	-2,72%	-8,40%	-10,89%	20.278.606,76	3,33%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	-0,98%	-8,98%	-9,87%	12.424.646,07	2,04%
RENDA VARIÁVEL		2,27%	-6,77%	-4,65%	171.256.437,55	28,09%
IBOVESPA		-1,63%	-8,43%	-9,92%		
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)		-1,47%	-8,28%	-9,62%		
META ATUARIAL (INPC + 4,90%)		0,59%	0,57%	1,16%	-	-

Plano PGA - Renda Variável						
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Rentab. 2020	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	-5,83%	-3,63%	163.786,10	0,02%
RENDA VARIÁVEL		2,34%	-5,83%	-3,62%	163.786,10	100,00%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-8,43%	-9,92%	-	-
META ATUARIAL (INPC + 4,50%)		0,56%	0,54%	1,10%	-	-

Plano PRV - Investimentos Estruturados					
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,27%	-3,16%	0,01%	7.032.816,17	0,71%
FIP Kinea	-10,51%	13,56%	1,62%	5.756.702,40	0,58%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	0,03%	-1,10%	14.920.453,35	1,50%
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	-0,07%	-0,05%	1.659.145,40	0,17%
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	2,31%	18.048.121,75	1,82%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	-0,83%	0,81%	24.730.105,72	2,49%
FMM BAHIA MARAÚ	-0,18%	-0,95%	-1,13%	11.051.876,46	1,11%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,95%	-1,13%	15.938.578,90	1,61%
FMM AZ QUEST Multi	0,75%	0,88%	1,64%	17.054.385,21	1,72%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	-3,15%	3.002.304,97	0,30%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,04%	-0,09%	-0,05%	6.867.373,27	0,69%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	0,57%	0,34%	0,91%	126.061.863,60	12,71%
META ATUARIAL (INPC + 5,10% a.a.)	0,61%	0,58%	1,19%		

Plano CV - Investimentos Estruturados					
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,27%	-3,16%	0,01%	2.344.272,06	0,38%
FIP Kinea	-10,51%	13,56%	1,62%	2.878.332,28	0,47%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	0,03%	-1,10%	2.982.727,02	0,49%
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	-0,07%	-0,05%	995.487,24	0,16%
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	2,31%	14.251.218,64	2,34%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	-0,83%	0,81%	17.414.724,78	2,86%
FMM BAHIA MARAÚ	-0,18%	-0,95%	-1,13%	9.864.310,40	1,62%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,95%	-1,13%	5.823.711,52	0,96%
FMM AZ QUEST MULTI FIM	0,75%	0,88%	1,64%	12.601.624,72	2,07%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	-3,15%	4.838.589,25	0,79%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,54%	0,35%	0,89%	73.994.997,91	12,14%
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,57%	1,16%		100,00%

Plano PGA - Investimentos Estruturados					
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	2,31%	1.452.267,86	3,71%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	-0,83%	0,81%	1.028.476,85	2,62%
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,95%	-1,13%	204.340,76	0,52%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	-3,15%	244.473,41	0,62%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,59%	0,47%	1,06%	2.929.558,88	7,47%
META GESTÃO (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,54%	1,10%	-	-

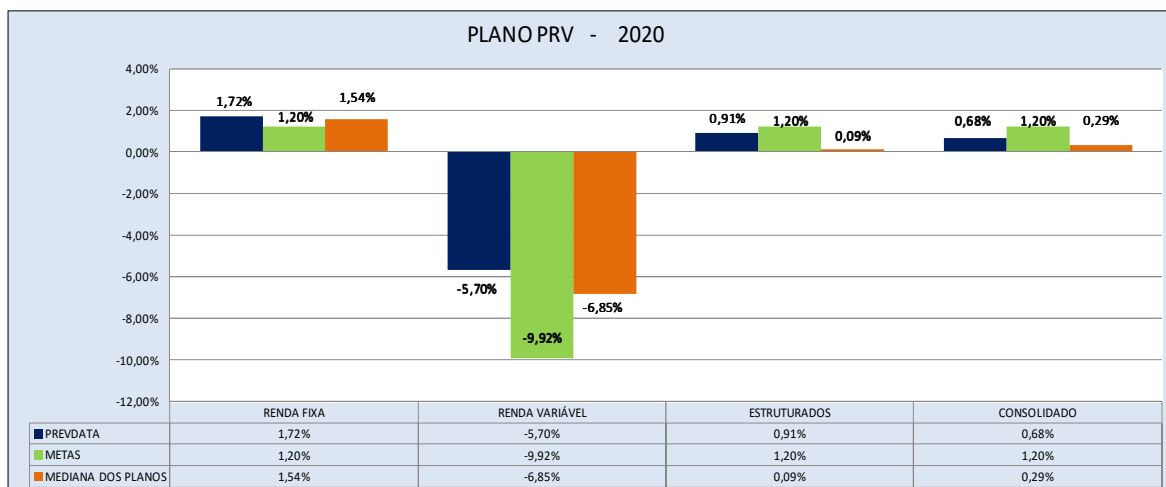
✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/20	02/20	2020
CONSOLIDADO	1,19%	-0,49%	0,69%
RENTA FIXA	1,21%	0,52%	1,74%
RENTA VARIÁVEL	1,71%	-7,28%	-5,70%
IMOBILIÁRIO	0,56%	0,57%	1,13%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,91%	3,12%
ESTRUTURADOS	0,57%	0,34%	0,91%
CDI	0,38%	0,29%	0,67%
IBOVESPA	-1,63%	-8,43%	-9,92%
META ATUARIAL (INPC + 5,10%)	0,61%	0,59%	1,20%

PLANO CV	01/20	02/20	2020
CONSOLIDADO	1,10%	-1,60%	-0,52%
RENTA FIXA	0,58%	0,49%	1,08%
RENTA VARIÁVEL	2,27%	-6,77%	-4,65%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,88%	3,09%
ESTRUTURADOS	0,54%	0,35%	0,89%
META ATUARIAL (INPC + 4,90%)	0,59%	0,57%	1,16%

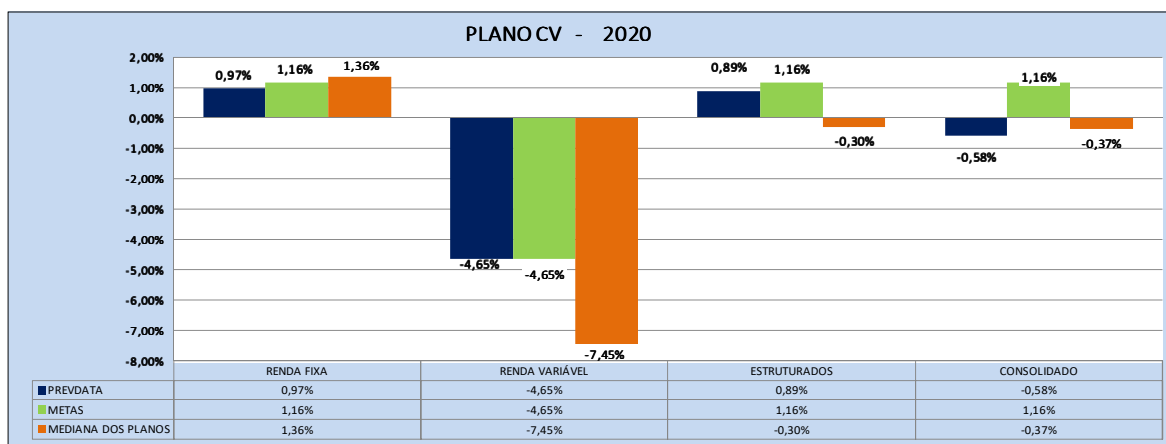
PLANO PGA	01/20	02/20	2020
CONSOLIDADO	0,78%	0,38%	1,16%
RENTA FIXA	0,79%	0,40%	1,19%
RENTA VARIÁVEL	2,34%	-5,83%	-3,62%
ESTRUTURADOS	0,59%	0,47%	1,06%
META DE GESTÃO (INPC + 4,50%)	0,56%	0,54%	1,10%

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV:



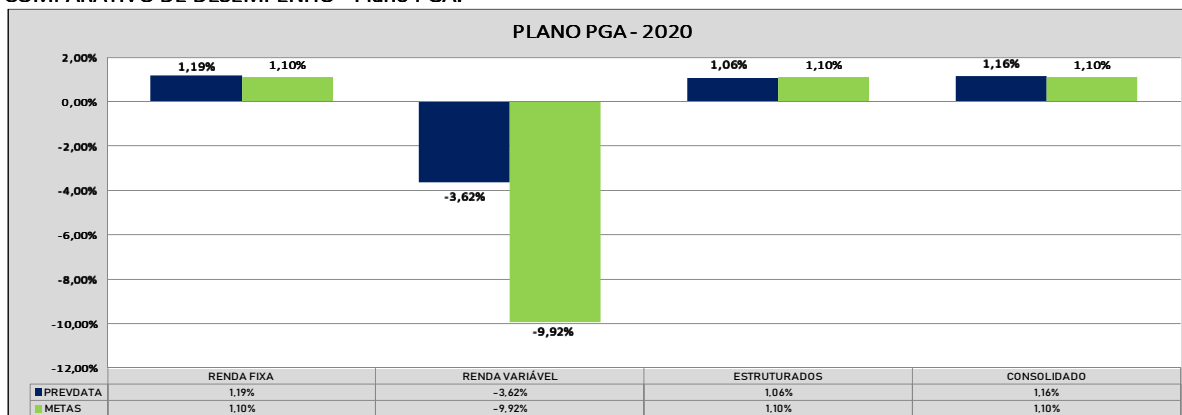
Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

✓ 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

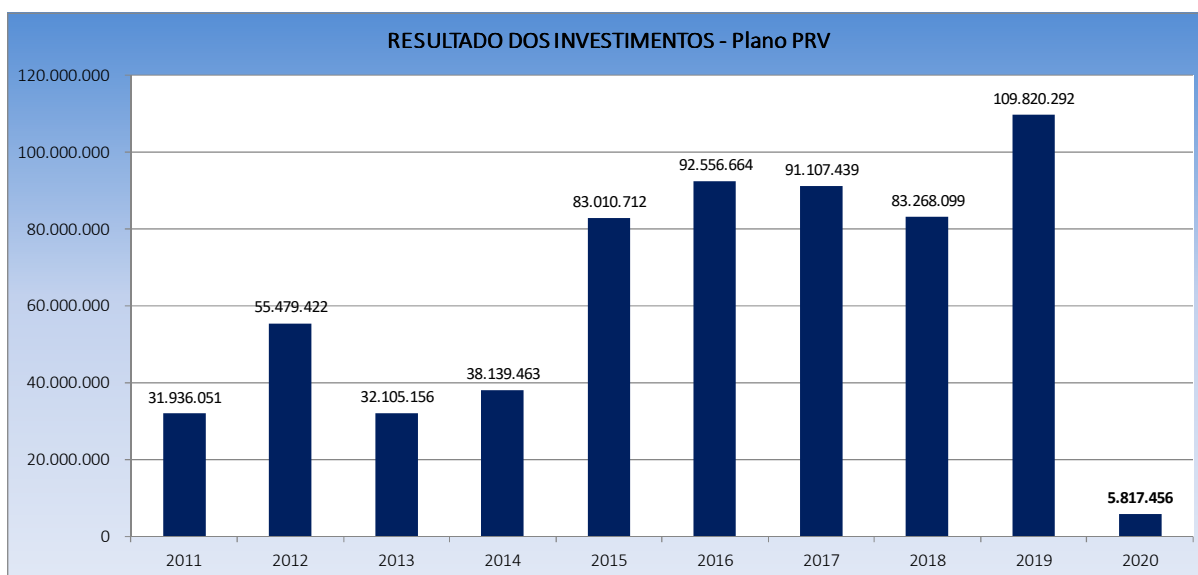
www.prevdata.org.br

✓ Demonstração de Resultado até FEV/20:

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
2020	-60.856.919,25	-85.546.013,16	67.365.692,00	-18.180.321,16

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\$ 85.546.013,16** deduzimos o valor de **R\$ 67.365.692,00**, referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como déficit técnico remanescente a quantia de - **R\$ 18.180.321,16**, sem considerar os demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 4.837.632,78**.



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

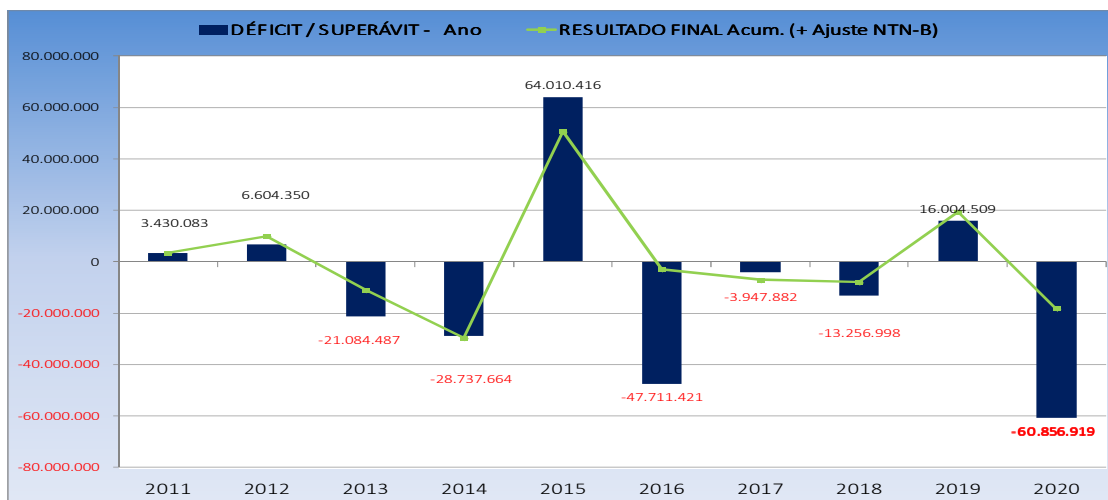
Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

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	1,20%	10,23%	9,12%	7,94%	12,76%	17,73%	74,42%
CONSOLIDADO	0,68%	12,72%	10,34%	12,39%	14,45%	14,73%	84,81%
RENDA FIXA	1,72%	9,58%	9,65%	9,69%	14,02%	18,36%	80,94%
RENDA VARIÁVEL	-5,70%	40,91%	28,96%	49,39%	26,93%	-16,04%	172,79%
IMOBILIÁRIO	1,14%	7,85%	30,10%	10,87%	8,98%	33,14%	128,27%
OPER. PARTICIPANTES	3,12%	11,09%	12,66%	10,30%	16,93%	19,04%	98,13%
ESTRUTURADOS	0,91%	8,11%	8,05%	39,50%	15,33%	-15,92%	59,47%

PLANO CV	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	1,16%	10,23%	9,12%	7,88%	12,66%	17,67%	74,03%
CONSOLIDADO	-0,58%	16,33%	10,04%	16,19%	18,01%	8,01%	88,48%
RENDA FIXA	0,97%	9,35%	8,38%	11,17%	16,69%	23,55%	91,80%
RENDA VARIÁVEL	-4,65%	41,71%	21,58%	35,60%	24,87%	-8,60%	154,23%
OPER. PARTICIPANTES	3,09%	11,15%	12,50%	10,16%	16,74%	18,98%	97,23%
ESTRUTURADOS	0,89%	8,23%	5,59%	32,42%	18,52%	-8,23%	66,07%

PLANO PGA	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	1,10%	9,71%	8,61%	7,68%	12,44%	17,40%	71,22%
CONSOLIDADO	1,16%	8,99%	8,21%	10,11%	14,05%	15,78%	73,46%
RENDA FIXA	1,19%	8,27%	8,59%	9,92%	14,04%	15,78%	72,67%
**RENDA VARIÁVEL	-3,62%	19,37%	-	-	-	-	15,05%
* ESTRUTURADOS	1,06%	11,98%	4,55%	18,98%	2,10%	-	43,74%

ÍNDICES	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
CDI	0,67%	5,95%	6,42%	9,93%	14,00%	13,24%	61,08%
IBOVESPA	-9,92%	31,59%	15,04%	26,86%	38,94%	-13,31%	108,37%
INPC	0,36%	4,48%	3,43%	2,07%	6,58%	11,24%	31,24%
IPCA	0,46%	4,31%	3,75%	2,95%	6,29%	10,67%	31,65%
SELIC	0,65%	5,96%	6,43%	9,94%	14,02%	13,27%	61,16%

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