

Relatório de Investimentos

Março – 2019

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

1

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	755.628.018,11	80,6%	352.252.043,94	68,2%	32.187.724,87	93,9%	1.140.067.786,92	76,6%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	70.879.763,58	7,6%	57.224.011,07	11,1%	2.084.647,22	6,1%	130.188.421,87	8,7%
RENTA VARIÁVEL	73.889.474,48	7,9%	77.623.474,76	15,0%	0,00	0,0%	151.512.949,24	10,2%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%
IMÓVEIS	4.516.430,44	0,5%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	4.516.430,44	0,3%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	33.022.211,24	3,5%	29.407.971,28	5,7%	0,00	0,0%	62.430.182,52	4,2%
TOTAL	937.935.897,85	100,0%	516.507.501,05	100,0%	34.272.372,09	100,0%	1.488.715.770,99	100,0%
PL MÊS ANTERIOR	933.213.318,01		510.593.655,18		34.141.689,47		1.477.948.662,66	

Plano PRV - Renda Fixa						
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	10,04%	15,30%	-1,90%	24,47%	104.815,95	0,01%
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,05%	177.466,30	0,02%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	1,58%	9.336.393,51	1,00%
Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	0,46%	1,48%	29.194.657,76	3,11%
Fundo Cx - Safra Capital	0,52%	0,49%	0,26%	1,28%	-	-
*Fundo Cx - Santander Institucional	0,07%	-	-	0,07%	-	-
** Fundo Cx - AZ Quest Luce	-	-	0,30%	0,30%	2.006.098,33	0,21%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,09%	0,09%	5.004.321,07	0,53%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	1,61%	48.578.706,94	5,18%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	1,45%	55.245.244,20	5,89%
Letra Finan.	0,85%	0,79%	1,00%	2,66%	34.812.016,14	3,71%
Título Público - NTN-B	0,85%	0,77%	1,00%	2,64%	571.168.297,91	60,90%
RENTA FIXA	0,79%	0,72%	0,89%	2,42%	755.628.018,11	80,56%
META ATUARIAL (INPC+ 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%		

*Fundo Cx - Santander Institucional - resgate total em 07/01/19

**Fundo Cx - AZ Quest Luce - início em 13/03/19

***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP - início em 26/03/19

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 Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,05%	101.409,28	0,02%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	1,58%	7.592.232,09	1,47%
Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	0,46%	1,48%	41.855.728,97	8,10%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	1,61%	49.659.574,08	9,61%
Fundo Cx - Safra Capital	0,52%	0,49%	0,45%	1,47%	4.962.321,16	0,96%
*Fundo Cx - Santander Institucional	0,62%	0,49%	0,22%	1,34%	-	-
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	1,45%	42.019.747,79	8,14%
** Fundo Cx - AZ Quest Luce	-	-	0,30%	0,30%	14.276.947,02	2,76%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,32%	0,32%	9.864.209,00	1,91%
Letra Finan.	0,88%	0,79%	1,02%	2,71%	13.803.473,98	2,67%
Título Público - NTN-B	1,77%	0,65%	0,75%	3,20%	168.116.400,57	32,55%
RENTA FIXA	1,16%	0,58%	0,63%	2,39%	352.252.043,94	68,20%
META DE GESTÃO (CDI + 1,3% a.a.)	0,65%	0,60%	0,58%	1,84%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%	-	-

*Fundo Cx - Santander Institucional - resgate total em 07/01/19

**Fundo Cx - AZ Quest Luce - início em 13/03/19

***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP - início em 14/03/19

PGA - Renda Fixa						
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,05%	25.352,34	0,07%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	1,58%	538.638,09	1,57%
*Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	-	1,01%	-	-
**Fundo Cx - AZ Quest Luce	-	-	0,48%	0,48%	1.688.121,96	4,93%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,37%		602.241,45	1,76%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	1,61%	3.372.437,15	9,84%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	1,45%	4.476.789,09	13,06%
Título Público - NTN-B	0,91%	0,70%	0,89%	2,52%	21.484.144,79	62,69%
RENTA FIXA	0,78%	0,63%	0,75%	2,19%	32.187.724,87	93,92%
META ATUARIAL (INPC + 5,00% a.a.)	0,77%	0,95%	1,18%	2,93%		

*Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo - Resgate Total em 28/02/2019

**Fundo Cx - AZ Quest Luce - Início em 28/02/2019

***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP - início em 12/03/19

Plano PRV - Renda Variável							
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Rentab. 2019	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	11,56%	-2,23%	1,41%	10,61%	13.365.265,28	1,42%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Valor	7,44%	-3,48%	0,05%	3,75%	21.337.883,98	2,27%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	8,34%	-0,76%	-0,48%	7,00%	13.569.620,56	1,45%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	10,07%	-1,86%	-0,62%	7,35%	16.498.800,17	1,76%
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Valor	10,52%	-2,80%	-0,90%	6,46%	9.117.904,49	0,97%
RENTA VARIÁVEL		9,29%	-2,32%	-0,07%	6,68%	73.889.474,48	7,88%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		10,82%	-1,86%	-0,18%	8,56%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,81%	0,99%	1,22%	3,05%	-	-

Plano CV - Renda Variável							
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Rentab. 2019	Patrimônio	% sobre PL
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livre	10,52%	-2,80%	-0,90%	6,46%	6.094.346,88	1,18%
OCEANA VALOR FIC AÇÕES	Índice Ativo	11,15%	-1,54%	0,11%	9,56%	12.198.500,51	2,36%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	8,98%	-1,20%	-0,32%	7,33%	7.407.710,56	1,43%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	11,56%	-2,23%	1,41%	10,61%	11.573.375,10	2,24%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	10,22%	-1,46%	-1,45%	7,04%	16.322.625,32	3,16%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Valor	7,44%	-3,48%	0,05%	3,75%	11.049.975,64	2,14%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	8,34%	-0,76%	-0,48%	7,00%	6.761.433,20	1,31%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	10,07%	-1,86%	-0,62%	7,35%	6.215.507,55	1,20%
RENTA VARIÁVEL		9,88%	-1,93%	-0,27%	7,46%	77.623.474,76	15,03%
IBOVESPA		10,82%	-1,86%	-0,18%	8,56%		
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)		11,00%	-1,70%	-0,02%	9,10%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,81%	0,99%	1,22%	3,05%	-	-

Plano PRV - Investimentos Estruturados						
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,33%	-0,27%	-0,38%	2,66%	5.905.425,86	0,63%
FIP Kinea	-0,05%	-19,46%	-0,06%	-19,55%	8.182.082,69	0,87%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-0,51%	0,13%	4,34%	3,94%	11.517.210,89	1,23%
FIP Brasil Energia Renovável	-0,09%	-0,08%	-0,08%	-0,25%	2.409.787,17	0,26%
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	2,16%	9.128.343,32	0,97%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-1,39%	12.970.395,86	1,38%
FMM BAHIA MARAÚ	2,30%	0,63%	0,55%	3,51%	10.485.945,69	1,12%
FMM AZ QUEST Multi	1,68%	-0,48%	-0,24%	0,95%	4.626.357,78	0,49%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	3,23%	2.796.377,15	0,30%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	1,47%	2.857.837,17	0,30%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	1,76%	-3,27%	0,51%	-1,06%	70.879.763,58	7,56%
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%		

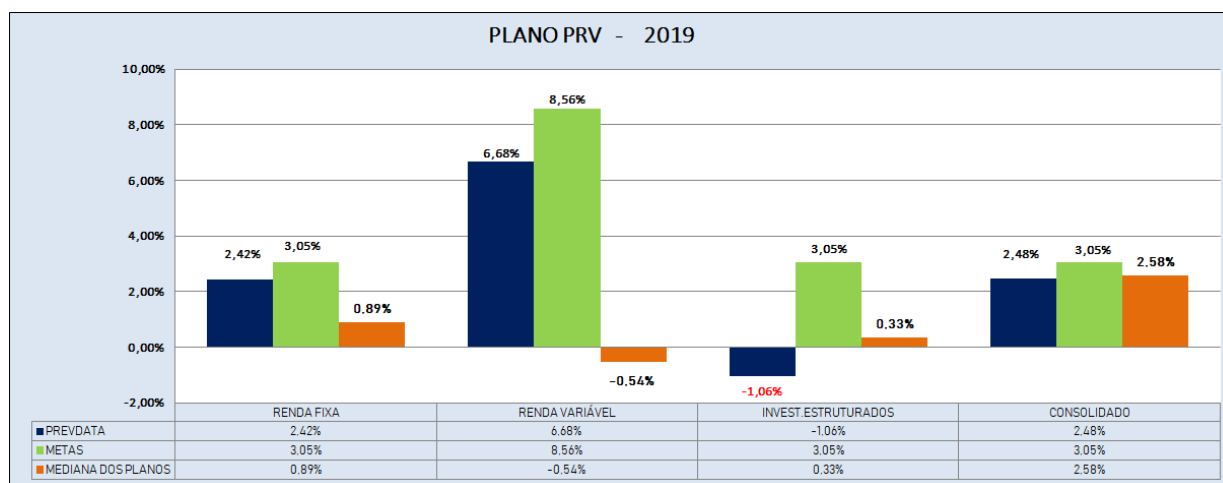
Plano CV - Investimentos Estruturados						
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,33%	-0,27%	-0,38%	2,66%	1.968.475,27	0,38%
FIP Kinea	-0,05%	-19,46%	-0,06%	-19,55%	4.091.014,46	0,79%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-0,51%	0,13%	4,34%	3,94%	2.302.260,95	0,45%
FIP Brasil Energia Renovável	-0,09%	-0,08%	-0,08%	-0,25%	1.445.872,31	0,28%
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	2,16%	9.081.670,40	1,76%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-1,39%	10.748.815,96	2,08%
FMM BAHIA MARAÚ	2,30%	0,63%	0,55%	3,51%	9.359.191,04	1,81%
FMM AZ QUEST MULTI FIM	1,68%	-0,48%	-0,24%	0,95%	5.100.856,01	0,99%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	3,23%	6.491.589,81	1,26%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	1,47%	6.634.264,86	1,28%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2,09%	-2,31%	0,03%	-0,23%	57.224.011,07	11,08%
META DE GESTÃO (INPC + 8% a.a.)	1,01%	1,19%	1,42%	3,65%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%	-	-

Plano PGA - Investimentos Estruturados						
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	2,16%	1.040.741,97	3,04%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-1,39%	583.490,65	1,70%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	3,23%	227.705,00	0,66%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	1,47%	232.709,60	0,68%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2,99%	-1,17%	-0,60%	1,18%	2.084.647,22	6,08%
META ATUARIAL (INPC + 5,00% a.a.)	0,77%	0,95%	1,18%	2,93%	-	-

✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/19	02/19	03/19	2019	PLANO CV	01/19	02/19	03/19	2019
CONSOLIDADO	1,50%	0,17%	0,79%	2,48%	CONSOLIDADO	2,52%	-0,13%	0,45%	2,85%
RENTA FIXA	0,79%	0,72%	0,89%	2,42%	RENTA FIXA	1,16%	0,58%	0,63%	2,39%
RENTA VARIÁVEL	9,29%	-2,32%	-0,07%	6,68%	RENTA VARIÁVEL	9,88%	-1,93%	-0,27%	7,46%
IMÓVEIS	1,05%	1,04%	1,18%	3,29%	EMPRESTIMOS	0,67%	0,81%	1,02%	2,52%
EMPRÉSTIMOS	0,67%	0,82%	1,04%	2,56%	INVEST. ESTRUTURADOS	2,09%	-2,31%	0,03%	-0,23%
INVEST. ESTRUTURADOS	1,76%	-3,27%	0,51%	-1,06%	TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	1,51%					
IBRX	10,71%	-1,76%	-0,11%	8,64%	PLANO PGA	01/19	02/19	03/19	2019
IBOVESPA	10,82%	-1,86%	-0,18%	8,56%	CONSOLIDADO	0,92%	0,52%	0,67%	2,12%
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	0,81%	0,99%	1,22%	3,05%	RENTA FIXA	0,78%	0,63%	0,75%	2,19%
					INVEST. ESTRUTURADOS	2,99%	-1,17%	-0,60%	1,18%
					TX. ATUARIAL (INPC + 5,00%)	0,77%	0,95%	1,18%	2,93%

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV:



* Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

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

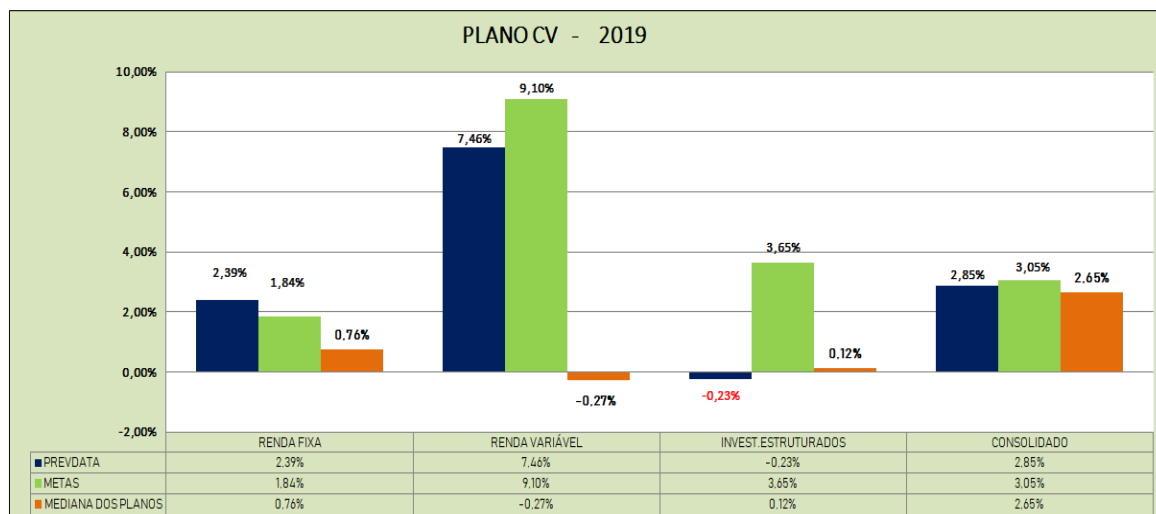
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

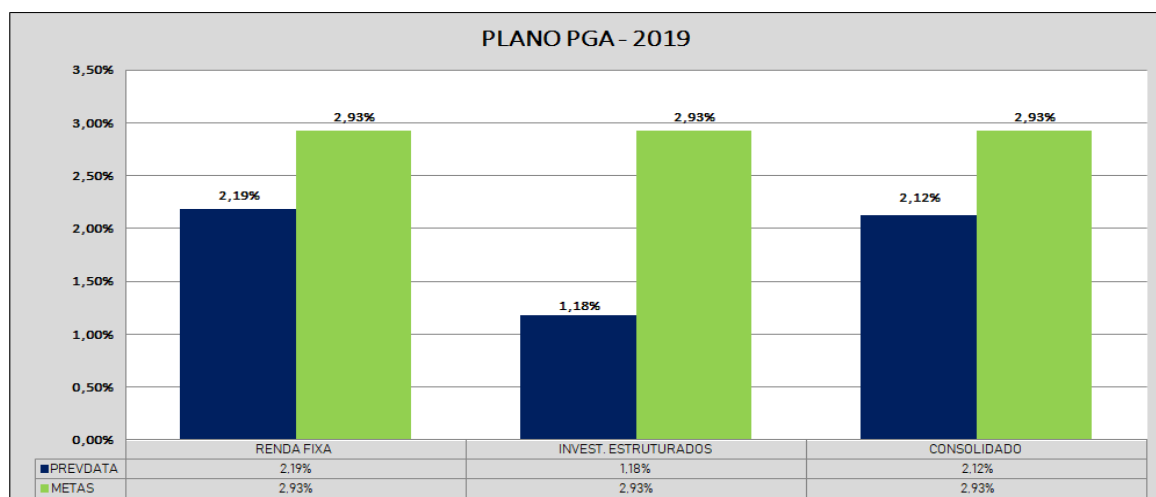
E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano CV:



✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



✓ Demonstração de Resultado até Mar/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	-110.608,93	-40.804.212,06	32.711.944,00	-8.092.268,06

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

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\$ 40.804** deduzimos o valor de **R\$ 32.711** referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como déficit técnico remanescente a quantia de **R\$ 8.092**, amplamente cobertos pelos demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 14.328**.

7

✓ RENTABILIDADE ACUMULADA DOS PLANOS:

PLANO PRV	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	3,05%	9,12%	7,94%	12,76%	17,73%	61,13%
CONSOLIDADO	2,48%	10,34%	12,39%	14,45%	14,73%	66,87%
RENTA FIXA	2,42%	9,65%	9,69%	14,02%	18,36%	66,24%
RENTA VARIÁVEL	6,68%	28,96%	49,39%	26,93%	-16,04%	119,01%
IMÓVEIS	3,29%	30,10%	10,87%	8,98%	33,14%	116,18%
EMPRÉSTIMOS	2,56%	12,66%	10,30%	16,93%	19,04%	77,37%
INVEST. ESTRUTURADOS	-1,06%	8,05%	39,50%	15,33%	-15,92%	44,62%
PLANO CV	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	3,05%	9,12%	7,88%	12,66%	17,67%	60,82%
CONSOLIDADO	2,85%	10,04%	16,19%	18,01%	8,01%	67,61%
RENTA FIXA	2,39%	8,38%	11,17%	16,69%	23,55%	77,87%
RENTA VARIÁVEL	7,46%	21,58%	35,60%	24,87%	-8,60%	102,19%
EMPRÉSTIMOS	2,52%	12,50%	10,16%	16,74%	18,98%	76,47%
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,23%	5,59%	32,42%	18,52%	-8,23%	51,72%
PLANO PGA	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	2,93%	8,61%	7,68%	12,44%	17,40%	58,89%
CONSOLIDADO	2,12%	8,21%	10,11%	14,05%	15,78%	60,67%
RENTA FIXA	2,19%	8,59%	9,92%	14,04%	15,78%	61,04%
* INVEST. ESTRUTURADOS	1,18%	4,55%	18,98%	2,10%	-	28,51%
ÍNDICES	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
CDI	1,51%	6,42%	9,93%	14,00%	13,24%	53,30%
IBOVESPA	8,56%	15,04%	26,86%	38,94%	-13,31%	90,84%
IBRX	8,64%	15,42%	27,55%	36,70%	-12,41%	91,51%
INPC	1,68%	3,43%	2,07%	6,58%	11,24%	27,27%
IPCA	1,51%	3,75%	2,95%	6,29%	10,67%	27,53%
SELIC	1,59%	6,43%	9,94%	14,02%	13,27%	53,51%

* Obs.: O segmento de Investimentos Estruturados no Plano PGA, teve início em Dez./2016

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