

Relatório de Investimentos Abril – 2018

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	705.506.123,10	80,6%	294.911.731,55	67,6%	29.684.251,80	94,8%	1.030.102.106,45	76,7%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	66.419.495,81	7,6%	47.985.712,76	11,0%	1.639.143,85	5,2%	116.044.352,42	8,6%
RENTA VARIÁVEL	64.774.114,68	7,4%	68.164.987,91	15,6%	0,00	0,0%	132.939.102,59	9,9%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%
IMÓVEIS	5.216.760,20	0,6%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	5.216.760,20	0,4%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	33.310.390,00	3,8%	25.142.974,83	5,8%	0,00	0,0%	58.453.364,83	4,4%
TOTAL	875.226.883,79	100,0%	436.205.407,05	100,0%	31.323.395,65	100,0%	1.342.755.686,49	100,0%

Plano PRV – Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	7,04%	4,28%	0,39%	22,39%	37,15%	83.659,53	0,01%
Fundo Crédito – Emissão Prim. II	2,44%	-0,01%	-1,94%	2,72%	3,17%	177.634,32	0,02%
Fundo Cx – Bradesco H Ref. Executivo	0,57%	0,45%	0,51%	0,50%	2,05%	30.529.456,43	3,49%
Fundo Cx – Safra Capital	0,56%	0,45%	0,52%	0,50%	2,05%	20.394.827,69	2,33%
Fundo Cx – Santander Institucional	0,66%	0,33%	0,60%	0,46%	2,07%	33.519.670,74	3,83%
Fundo Cx – Rio Bravo Crédito Priv.	0,59%	0,50%	0,54%	0,52%	2,17%	23.204.921,22	2,65%
Fundo Cx – BNP Paribas Match DI	0,56%	0,45%	0,51%	0,50%	2,04%	25.225.806,40	2,88%
Letra Finan.	1,12%	0,70%	0,79%	0,72%	3,37%	54.740.256,23	6,25%
Título Público – NTN-B	1,08%	0,65%	0,76%	0,68%	3,21%	517.629.890,54	59,14%
RENTA FIXA	0,97%	0,60%	0,71%	0,65%	2,97%	705.506.123,10	80,61%
META DE GESTÃO (INPC+ 5,50% a.a.)	0,68%	0,63%	0,52%	0,66%	2,50%		

Plano CV – Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito – Emissão Prim. II	2,44%	-0,01%	-1,94%	2,72%	3,17%	101.505,28	0,02%
Fundo Cx – Bradesco H Ref. Executivo	0,57%	0,45%	0,51%	0,50%	2,05%	26.218.171,47	6,01%
Fundo Cx – Rio Bravo Crédito Priv.	0,59%	0,50%	0,54%	0,52%	2,17%	22.622.831,15	5,19%
Fundo Cx – Safra Capital	0,56%	0,45%	0,52%	0,50%	2,05%	29.576.156,50	6,78%
Fundo Cx – Santander Institucional	0,66%	0,33%	0,60%	0,46%	2,07%	21.777.940,51	4,99%
Fundo Cx – BNP Paribas Match DI	0,56%	0,45%	0,51%	0,50%	2,04%	28.009.504,71	6,42%
Letra Finan.	1,09%	0,68%	0,51%	0,71%	3,02%	12.537.556,37	2,87%
Título Público – NTN-B	1,64%	0,49%	1,08%	0,34%	3,59%	154.068.065,56	35,32%
RENTA FIXA	1,16%	0,47%	0,83%	0,42%	2,90%	294.911.731,55	67,61%
META DE GESTÃO (CDI + 1,3% a.a.)	0,69%	0,57%	0,64%	0,63%	2,55%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,68%	0,63%	0,52%	0,66%	2,50%	-	-

PGA - Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	2,44%	-0,01%	-1,94%	2,72%	3,17%	25.376,34	0,08%
Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,57%	0,45%	0,51%	0,50%	2,05%	2.093.231,55	6,68%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,59%	0,50%	0,53%	0,52%	2,16%	1.944.470,11	6,21%
Fundo Cx - Safra Capital	0,56%	0,45%	0,52%	0,50%	2,05%	1.814.860,83	5,79%
Fundo Cx - Santander Institucional	0,66%	0,33%	0,60%	0,46%	2,07%	2.717.578,15	8,68%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,56%	0,45%	0,51%	0,50%	2,04%	2.163.893,08	6,91%
Título Público - NTN-B	1,11%	0,54%	0,96%	0,58%	3,23%	18.924.841,74	60,42%
RENTA FIXA	0,93%	0,50%	0,80%	0,55%	2,81%	29.684.251,80	94,77%
META DE GESTÃO (INPC + 5,00% a.a.)	0,64%	0,59%	0,48%	0,62%	2,34%		

Plano PRV - Renda Variável					
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Rentab. Abril	Rentab. 2018	Patrimônio	% sobre PL
SUL AMÉRICA EXPERTISE II FI AÇÕES	Valor	6,19%	6,78%	8.516.263,34	0,97%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	-2,35%	2,33%	10.883.477,61	1,24%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Valor	0,34%	39,08%	18.192.222,09	2,08%
*BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	0,41%	0,41%	12.093.505,67	1,38%
**SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	0,69%	0,59%	15.088.645,97	1,72%
RENTA VARIÁVEL		0,69%	20,59%	64.774.114,68	7,40%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		0,88%	12,71%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,66%	2,50%	-	-

* Aplicação inicial em: 23/03/2018.

** Aplicação inicial em: 23/03/2018.

Plano CV - Renda Variável					
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Rentab. Abril	Rentab. 2018	Patrimônio	% sobre PL
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livre	1,82%	15,94%	3.959.033,34	0,91%
OCEANA VALOR FIC AÇÕES	Índice Ativo	0,61%	11,67%	10.452.215,15	2,40%
BRASIL PLURAL FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	0,12%	16,28%	6.532.012,30	1,50%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	-2,51%	2,19%	9.424.322,38	2,16%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	2,72%	18,40%	14.962.993,82	3,43%
SUL AMÉRICA EXPERTISE II FI AÇÕES	Valor	6,19%	6,78%	1.703.252,67	0,39%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Valor	0,34%	39,08%	9.420.972,15	2,16%
*BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	1,34%	1,34%	6.025.918,74	1,38%
**SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	0,65%	0,65%	5.684.267,46	1,30%
RENTA VARIÁVEL		0,54%	14,72%	68.164.987,91	15,63%
IBOVESPA		0,88%	12,71%		
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2% a.a)		1,05%	13,46%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,66%	2,50%	-	-

* Aplicação inicial em: 29/03/2018

** Aplicação inicial em: 29/03/2018.

Plano PRV - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	-0.18%	20.12%	0.36%	0.83%	21.33%	5.277.429.41	0.60%
FIP Kinea	-2.88%	8.04%	-0.03%	0.09%	4.99%	14.007.547.20	1.60%
FIP P2 III	0.00%	-0.06%	5.97%	0.09%	6.00%	8.032.655.97	0.92%
FIP Brasil Energia Renovável	-0.07%	-0.05%	-0.05%	2.79%	2.62%	2.426.708.85	0.28%
FMM IBIUNA Hedge	5.30%	1.77%	1.64%	-0.65%	8.21%	9.113.880.20	1.04%
FMM MAUÁ Macro	3.84%	1.38%	0.63%	-0.80%	5.09%	13.338.512.08	1.52%
FMM BBM MARAÚ	1.63%	1.85%	2.32%	0.72%	6.67%	9.829.410.79	1.12%
FMM AZ QUEST Multi	2.36%	1.44%	0.79%	0.14%	4.80%	4.393.351.31	0.50%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	1.06%	4.58%	1.41%	0.06%	7.24%	66.419.495.81	7.59%
META DE GESTÃO (INPC + 5.50% a.a.)	0.68%	0.63%	0.52%	0.66%	2.50%		

Plano CV - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	-0.18%	20.12%	0.36%	0.83%	21.33%	1.759.143.09	0.40%
FIP Kinea	-2.88%	8.04%	-0.03%	0.09%	4.99%	7.003.727.36	1.61%
FIP P2 III	0.00%	-0.06%	5.97%	0.09%	6.00%	1.605.932.17	0.37%
FIP Brasil Energia Renovável	-0.07%	-0.05%	-0.05%	2.79%	2.62%	1.456.025.31	0.33%
FMM IBIUNA Hedge	5.30%	1.77%	1.64%	-0.65%	8.21%	9.067.281.24	2.08%
FMM MAUÁ Macro	3.84%	1.38%	0.63%	-0.80%	5.09%	11.053.880.94	2.53%
FMM SAFRA Galileo	5.13%	-0.38%	-0.12%	0.45%	5.08%	2.422.567.90	0.56%
FMM BBM MARAÚ	1.63%	1.85%	2.32%	0.72%	6.67%	8.773.203.30	2.01%
FMM AZ QUEST	2.36%	1.44%	0.79%	0.14%	4.80%	4.843.951.45	1.11%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	1.96%	3.36%	1.10%	-0.01%	6.53%	47.985.712.76	11.00%
META DE GESTÃO (INPC + 8% a.a.)	0.87%	0.82%	0.71%	0.85%	3.31%		
META ATUARIAL (INPC + 5.50% a.a.)	0.68%	0.63%	0.52%	0.66%	2.50%	-	-

Plano PGA - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2018	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	5.30%	1.77%	1.64%	-0.65%	8.21%	1.039.093.10	3.32%
FMM MAUÁ Macro	3.84%	1.38%	0.63%	-0.80%	5.09%	600.050.85	1.92%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	4.60%	1.58%	1.24%	-0.71%	6.81%	1.639.143.85	5.23%
META ATUARIAL (INPC + 5.00% a.a.)	0.64%	0.59%	0.48%	0.62%	2.34%	-	-

✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

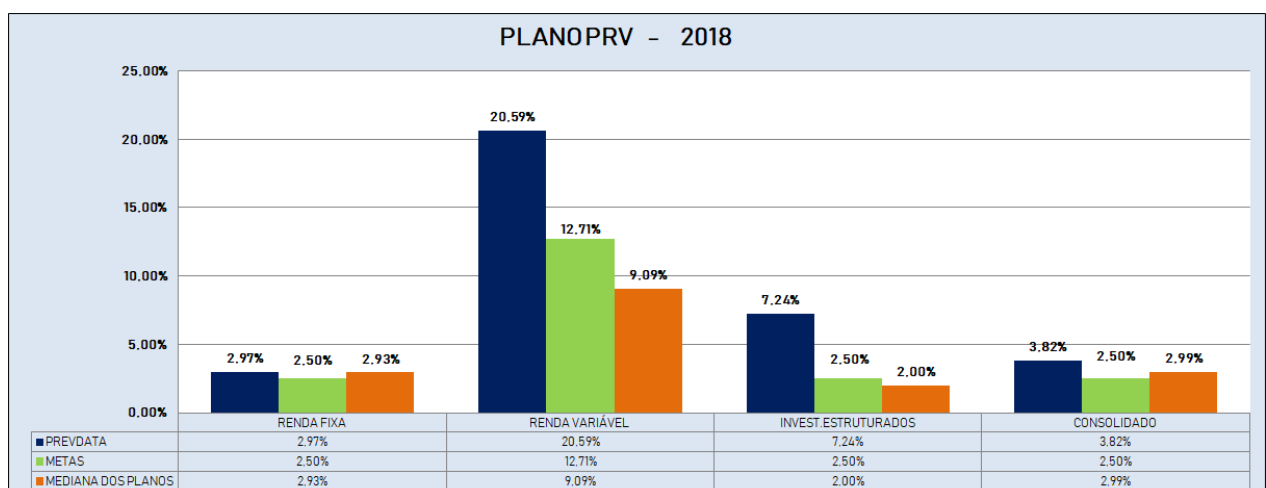
PLANO PRV	01/18	02/18	03/18	04/18	05/18	06/18	07/18	08/18	09/18	10/18	11/18	12/18	2018
CONSOLIDADO	1.31%	1.04%	0.80%	0.62%									3.82%
RENTA FIXA	0.97%	0.60%	0.71%	0.65%									2.97%
RENTA VARIÁVEL	10.88%	6.01%	1.90%	0.69%									20.59%
IMÓVEIS	0.88%	0.89%	0.91%	0.89%									3.61%
EMPRÉSTIMOS	0.82%	0.94%	0.90%	0.85%									3.55%
INVEST. ESTRUTURADOS	1.06%	4.58%	1.41%	0.06%									7.24%
CDI	0.58%	0.46%	0.53%	0.52%									2.11%
IBRX	10.74%	0.42%	0.08%	0.82%									12.21%
IBOVESPA	11.14%	0.52%	0.01%	0.88%									12.71%
TX. ATUARIAL (INPC + 5.50%)	0.68%	0.63%	0.52%	0.66%									2.50%

PLANO CV	01/18	02/18	03/18	04/18	05/18	06/18	07/18	08/18	09/18	10/18	11/18	12/18	2018
CONSOLIDADO	2.50%	1.02%	0.95%	0.42%									4.97%
RENTA FIXA	1.16%	0.47%	0.83%	0.42%									2.90%
RENTA VARIÁVEL	9.91%	2.37%	1.41%	0.54%									14.72%
EMPRESTIMOS	0.82%	0.93%	0.89%	0.83%									3.52%
INVEST. ESTRUTURADOS	1.96%	3.36%	1.10%	-0.01%									6.53%
TX. ATUARIAL (INPC + 5.50%)	0.68%	0.63%	0.52%	0.66%									2.50%

PLANO PGA	01/18	02/18	03/18	04/18	05/18	06/18	07/18	08/18	09/18	10/18	11/18	12/18	2018
CONSOLIDADO	1.00%	0.52%	0.81%	0.48%									2.85%
RENTA FIXA	0.93%	0.50%	0.80%	0.55%									2.81%
INVEST. ESTRUTURADOS	4.60%	1.58%	1.24%	-0.71%									6.81%
TX. ATUARIAL (INPC + 5.00%)	0.64%	0.59%	0.48%	0.62%									2.34%

* Rentabilidades auferidas pelo Gerencial de Investimentos, antes do fechamento contábil.

✓ 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

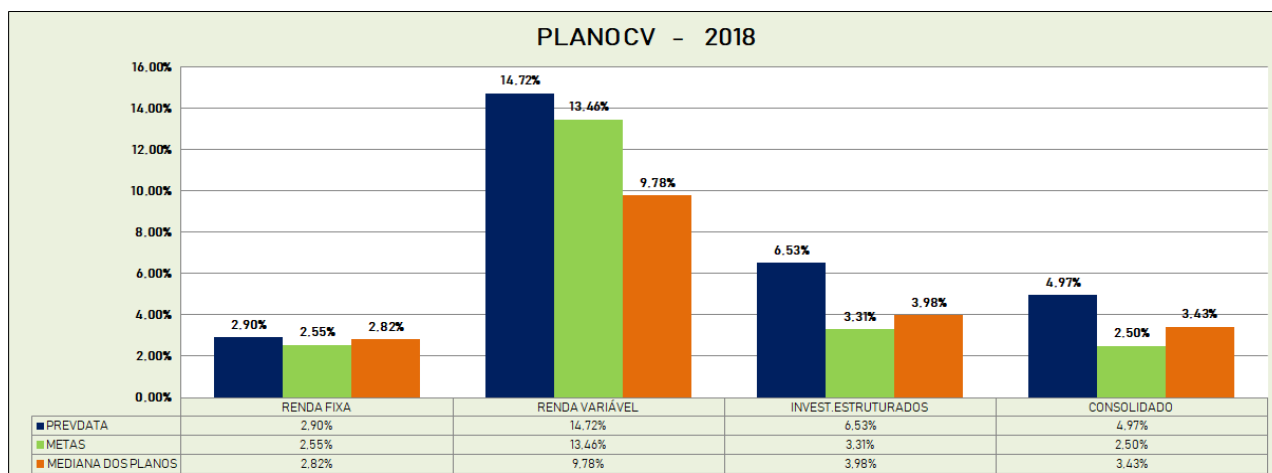
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

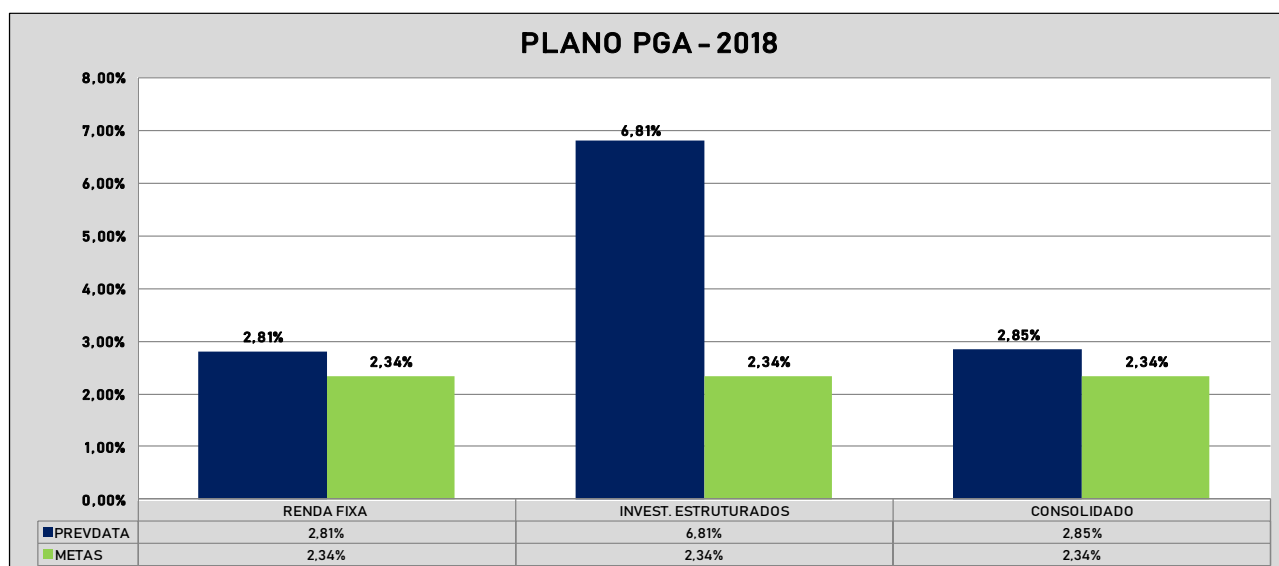
www.prevdata.org.br

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano CV:



* Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



✓ Demonstração de Resultado até Abr/18:

DEMONSTRAÇÃO CONTÁBIL -		PLANO PRV	DEMONSTRAÇÃO ATIVO LÍQUIDO	
Exercício	Superávit/Déficit	Resultado Acum.	Ajuste Precificação NTN-B	Resultado Final
2013	-21.084.487,45	-11.050.053,98	-	-
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	-14.542.751,26	-41.979.356,42	26.298.621,74	-15.680.734,68

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	2018	2017	2016	2015	2014	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	2.50%	7.94%	12.76%	17.73%	12.81%	65.69%
CONSOLIDADO	3.82%	12.39%	14.45%	14.73%	7.25%	64.34%
RENTA FIXA	2.97%	9.69%	14.02%	18.36%	13.62%	73.19%
RENTA VARIÁVEL	20.59%	49.39%	26.93%	-16.04%	-10.06%	72.66%
IMÓVEIS	3.61%	10.87%	8.98%	33.14%	4.13%	73.55%
EMPRÉSTIMOS	3.55%	10.30%	16.93%	19.04%	15.00%	82.83%
INVEST. ESTRUTURADOS	7.24%	39.50%	15.33%	-15.92%	2.94%	49.34%
PLANO CV	2018	2017	2016	2015	2014	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	2.50%	7.88%	12.66%	17.67%	12.39%	64.76%
CONSOLIDADO	4.97%	16.19%	18.01%	8.01%	8.15%	68.12%
RENTA FIXA	2.90%	11.17%	16.69%	23.55%	13.23%	86.74%
RENTA VARIÁVEL	14.72%	35.60%	24.87%	-8.60%	-8.56%	62.34%
EMPRÉSTIMOS	3.52%	10.16%	16.74%	18.98%	14.55%	81.42%
INVEST. ESTRUTURADOS	6.53%	32.42%	18.52%	-8.23%	2.96%	57.97%
PLANO PGA	2018	2017	2016	2015	2014	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	2.34%	7.68%	12.44%	17.40%	12.07%	63.03%
CONSOLIDADO	2.85%	10.11%	14.05%	15.78%	12.41%	68.09%
RENTA FIXA	2.81%	9.92%	14.04%	15.78%	12.41%	67.72%
INVEST. ESTRUTURADOS	6.81%	18.98%	2.10%	0.00%	0.00%	29.75%
ÍNDICES	2018	2017	2016	2015	2014	ACUMULADO
CDI	2.11%	9.93%	14.00%	13.24%	10.81%	60.57%
IBOVESPA	12.71%	26.86%	38.94%	-13.31%	-2.91%	67.21%
IBRX	12.21%	27.55%	36.70%	-12.41%	-2.78%	66.60%
INPC	0.69%	2.07%	6.58%	11.24%	6.23%	29.44%
IPCA	0.92%	2.95%	6.29%	10.67%	6.41%	30.05%
SELIC	2.12%	9.94%	14.02%	13.27%	10.90%	60.80%