

Relatório de Investimentos

Abril – 2019

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

1

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	726.449.860,62	76,8%	339.900.709,72	64,8%	32.181.121,70	93,5%	1.098.531.692,04	73,0%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	85.602.397,18	9,1%	63.600.771,13	12,1%	2.247.192,13	6,5%	151.450.360,44	10,1%
RENTA VARIÁVEL	95.379.418,81	10,1%	90.588.067,45	17,3%	0,00	0,0%	185.967.486,26	12,4%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	0,00	0,0%
IMÓVEIS	4.504.689,66	0,5%	0,00	0,0%	0,00	0,0%	4.504.689,66	0,3%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	33.628.735,93	3,6%	30.502.099,71	5,8%	0,00	0,0%	64.130.835,64	4,3%
TOTAL	945.565.102,20	100,0%	524.591.648,01	100,0%	34.428.313,83	100,0%	1.504.585.064,04	100,0%
PL MÊS ANTERIOR	937.935.897,82		516.506.477,05		34.272.372,08		1.488.714.746,95	

Plano PRV - Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	10,04%	15,30%	-1,90%	12,70%	40,27%	112.043,21	0,01%
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,07%	177.438,27	0,02%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	0,53%	2,12%	9.385.806,89	0,99%
****Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	0,46%	0,48%	1,96%	-	-
*****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%	0,53%	0,83%	12.052.072,29	1,27%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,09%	0,57%	0,66%	11.757.884,91	1,24%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	0,53%	2,15%	48.835.339,79	5,16%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	0,51%	1,96%	30.324.097,75	3,21%
Letra Finan.	0,85%	0,79%	1,00%	1,31%	4,01%	35.268.166,97	3,73%
Título Público - NTN-B	0,85%	0,77%	1,00%	1,29%	3,97%	578.537.010,54	61,18%
RENTA FIXA	0,79%	0,72%	0,89%	1,14%	3,59%	726.449.860,62	76,83%
META ATUARIAL (INPC+ 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%		

*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
 ****Fundo de Cx Bradesco H Executivo - resgate total em 29/04/2019 / ***** Fundo de Cx Safra Capital - resgate total em 19/03/2019

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

Plano CV - Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,07%	101.393,25	0,02%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	0,53%	2,12%	7.632.414,39	1,45%
Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	0,46%	0,51%	1,99%	18.291.552,40	3,49%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	0,53%	2,15%	49.921.916,95	9,52%
****Fundo Cx - Safra Capital	0,52%	0,49%	0,45%	0,19%	1,66%	-	-
*Fundo Cx - Santander Institucional	0,62%	0,49%	0,22%	-	1,34%	-	-
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	0,51%	1,96%	42.235.778,27	8,05%
** Fundo Cx - AZ Quest Luce	-	-	0,30%	0,53%	0,83%	20.366.976,34	3,88%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,32%	0,57%	0,89%	17.254.332,61	3,29%
Letra Finan.	0,88%	0,79%	1,02%	1,32%	4,07%	13.986.137,09	2,67%
Título Público - NTN-B	1,77%	0,65%	0,75%	1,19%	4,42%	170.110.208,42	32,43%
RENTA FIXA	1,16%	0,58%	0,63%	0,87%	3,28%	339.900.709,72	64,79%
META DE GESTÃO (CDI + 1,3%a.a.)	0,65%	0,60%	0,58%	0,63%	2,48%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%	-	-

*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
****Fundo Cx - Safra Capital - resgate total em 09/04/2019

PGA - Renda Fixa							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
Fundo Crédito - Emissão Prim. II	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,07%	25.348,34	0,07%
Fundo Crédito - Western Structured II	0,56%	0,51%	0,50%	0,53%	2,12%	541.488,86	1,57%
*Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo	0,53%	0,48%	-	-	1,01%	-	-
**Fundo Cx - AZ Quest Luce	-	-	0,48%	0,53%	1,01%	1.697.038,56	4,93%
***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP	-	-	0,37%	0,57%	0,94%	1.248.443,45	3,63%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,57%	0,53%	0,50%	0,53%	2,15%	3.390.253,15	9,85%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,50%	0,48%	0,46%	0,51%	1,96%	3.538.053,83	10,28%
Título Público - NTN-B	0,91%	0,70%	0,89%	1,19%	3,74%	21.740.502,51	63,15%
RENTA FIXA	0,78%	0,63%	0,75%	0,97%	3,18%	32.181.128,70	93,47%
META ATUARIAL (INPC + 5,00% a.a.)	0,77%	0,95%	1,18%	1,01%	3,97%		

*Fundo Cx - Bradesco H Ref. Executivo - Resgate Total em 28/02/19 / **Fundo Cx - AZ Quest Luce - Início em 28/02/19 / ***Fundo Cx - AF Invest FI RF CP - início em 12/03/19

Plano PRV - Renda Variável								
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Rentab. 2019	Patrimônio	% sobre PL
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	11,56%	-2,23%	1,41%	2,82%	13,73%	13.742.701,71	1,45%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	7,44%	-3,48%	0,05%	3,50%	7,38%	22.084.610,33	2,34%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	8,34%	-0,76%	-0,48%	0,39%	7,42%	18.622.835,95	1,97%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	10,07%	-1,86%	-0,62%	1,54%	9,01%	26.752.985,29	2,83%
*OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	-	-	-	0,29%	0,29%	5.014.718,55	0,53%
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	10,52%	-2,80%	-0,90%	0,48%	6,97%	9.161.566,98	0,97%
REDA VARIÁVEL		9,29%	-2,32%	-0,07%	1,92%	8,72%	95.379.418,81	10,09%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	9,63%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%	-	-

*OCCAM FIC AÇÕES - Inicio em 29/04/2019

Plano CV - Renda Variável								
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Rentab. 2019	Patrimônio	% sobre PL
BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES	Ações Livre	10,52%	-2,80%	-0,90%	0,48%	6,97%	6.123.530,61	1,17%
OCEANA VALOR FIC AÇÕES	Índice Ativo	11,15%	-1,54%	0,11%	1,73%	11,45%	12.409.237,30	2,37%
OCCAM FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	8,98%	-1,20%	-0,32%	0,91%	8,30%	7.475.064,82	1,42%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	11,56%	-2,23%	1,41%	2,82%	13,73%	11.900.208,36	2,27%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	10,22%	-1,46%	-1,45%	1,97%	9,14%	16.644.138,53	3,17%
PÁTRIA PIPE FEEDER I FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	7,44%	-3,48%	0,05%	3,50%	7,38%	11.436.673,21	2,18%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	Ações Dividendos	8,34%	-0,76%	-0,48%	0,39%	7,42%	13.287.949,22	2,53%
SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES	Índice Ativo	10,07%	-1,86%	-0,62%	1,54%	9,01%	11.311.265,40	2,16%
REDA VARIÁVEL		9,88%	-1,93%	-0,27%	1,86%	9,46%	90.588.067,45	17,27%
IBOVESPA		10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	9,63%		
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)		11,00%	-1,70%	-0,02%	1,15%	10,35%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50%)		0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%	-	-

Plano PRV - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,33%	-0,27%	-0,38%	0,36%	3,03%	5.926.793,43	0,63%
FIP Kinea	-0,05%	-19,46%	-0,06%	-0,03%	-19,57%	8.179.728,65	0,87%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-0,51%	0,13%	4,34%	0,34%	4,30%	11.556.651,89	1,22%
FIP Brasil Energia Renovável	-0,09%	-0,08%	-0,08%	-0,08%	-0,33%	2.407.759,73	0,25%
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	0,24%	2,40%	9.150.271,33	0,97%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-0,05%	-1,44%	12.963.351,18	1,37%
FMM BAHIA MARAÚ	2,30%	0,63%	0,55%	0,34%	3,86%	10.521.153,12	1,11%
FMM AZ QUEST Multi	1,68%	-0,48%	-0,24%	-0,02%	0,93%	15.438.030,79	1,63%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	-0,48%	2,73%	2.782.823,14	0,29%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	-0,02%	1,45%	6.675.833,92	0,71%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	1,76%	-3,27%	0,51%	0,16%	-0,90%	85.602.397,18	9,05%
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%		

Plano CV - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,33%	-0,27%	-0,38%	0,36%	3,03%	1.975.597,83	0,38%
FIP Kinea	-0,05%	-19,46%	-0,06%	-0,03%	-19,57%	4.089.837,47	0,78%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-0,51%	0,13%	4,34%	0,34%	4,30%	2.310.145,11	0,44%
FIP Brasil Energia Renovável	-0,09%	-0,08%	-0,08%	-0,08%	-0,33%	1.444.655,83	0,28%
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	0,24%	2,40%	9.103.486,30	1,74%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-0,05%	-1,44%	10.742.977,90	2,05%
FMM BAHIA MARAÚ	2,30%	0,63%	0,55%	0,34%	3,86%	9.390.615,29	1,79%
FMM AZ QUEST MULTI FIM	1,68%	-0,48%	-0,24%	-0,02%	0,93%	11.407.287,23	2,17%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	-0,48%	2,73%	6.460.125,14	1,23%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	-0,02%	1,45%	6.676.043,03	1,27%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2,09%	-2,31%	0,03%	0,12%	-0,11%	63.600.771,13	12,12%
META DE GESTÃO (INPC + 8% a.a.)	1,01%	1,19%	1,42%	1,25%	4,95%		
META ATUARIAL (INPC + 5,50% a.a.)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%	-	-

Plano PGA - Investimentos Estruturados							
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade 2019	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	3,78%	-0,96%	-0,61%	0,24%	2,40%	1.043.242,03	3,03%
FMM MAUÁ Macro	2,47%	-2,19%	-1,61%	-0,05%	-1,44%	583.173,74	1,69%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	3,25%	-1,17%	1,16%	-0,48%	2,73%	226.601,31	0,66%
FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE	0,56%	0,54%	0,36%	-0,02%	1,45%	394.175,05	1,14%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2,99%	-1,17%	-0,60%	0,12%	1,31%	2.247.192,13	6,53%
META ATUARIAL (INPC + 5,00% a.a.)	0,77%	0,95%	1,18%	1,01%	3,97%	-	-

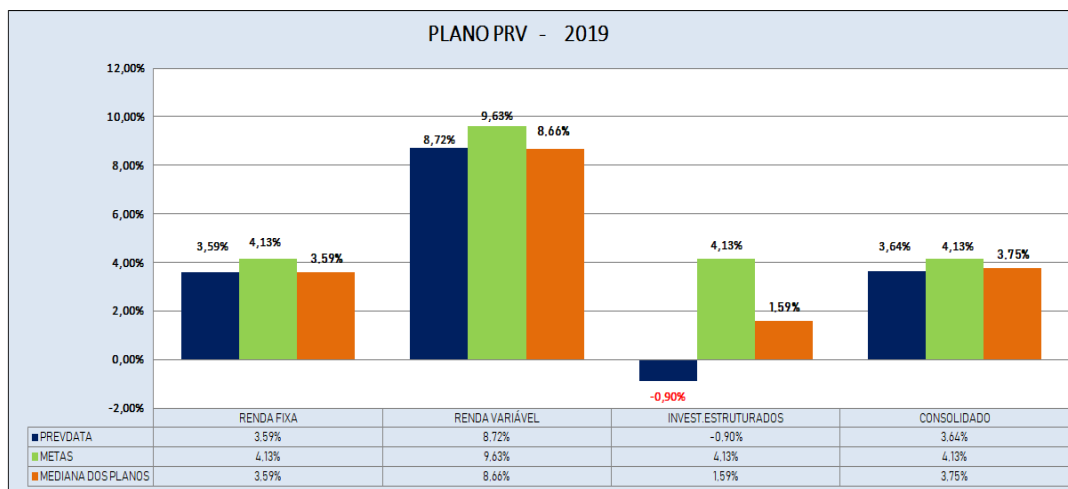
✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/19	02/19	03/19	04/19	2019
CONSOLIDADO	1,50%	0,17%	0,79%	1,13%	3,64%
RENTA FIXA	0,79%	0,72%	0,89%	1,14%	3,59%
RENTA VARIÁVEL	9,29%	-2,32%	-0,07%	1,92%	8,72%
IMÓVEIS	1,05%	1,04%	1,17%	-0,10%	3,18%
EMPRÉSTIMOS	0,67%	0,82%	1,04%	1,18%	3,77%
INVEST. ESTRUTURADOS	1,76%	-3,27%	0,51%	0,16%	-0,90%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	2,04%
IBRX	10,71%	-1,76%	-0,11%	1,05%	9,78%
IBOVESPA	10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	9,63%
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%

PLANO CV	01/19	02/19	03/19	04/19	2019
CONSOLIDADO	2,52%	-0,13%	0,45%	0,95%	3,83%
RENTA FIXA	1,16%	0,58%	0,63%	0,87%	3,28%
RENTA VARIÁVEL	9,88%	-1,93%	-0,27%	1,86%	9,46%
EMPRESTIMOS	0,67%	0,81%	1,02%	0,93%	3,47%
INVEST. ESTRUTURADOS	2,09%	-2,31%	0,03%	0,12%	-0,11%
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	4,13%

PLANO PGA	01/19	02/19	03/19	04/19	2019
CONSOLIDADO	0,92%	0,52%	0,67%	0,92%	3,06%
RENTA FIXA	0,78%	0,63%	0,75%	0,97%	3,18%
INVEST. ESTRUTURADOS	2,99%	-1,17%	-0,60%	0,12%	1,31%
TX. GESTÃO (INPC + 5,00%)	0,77%	0,95%	1,18%	1,01%	3,97%

✓ 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

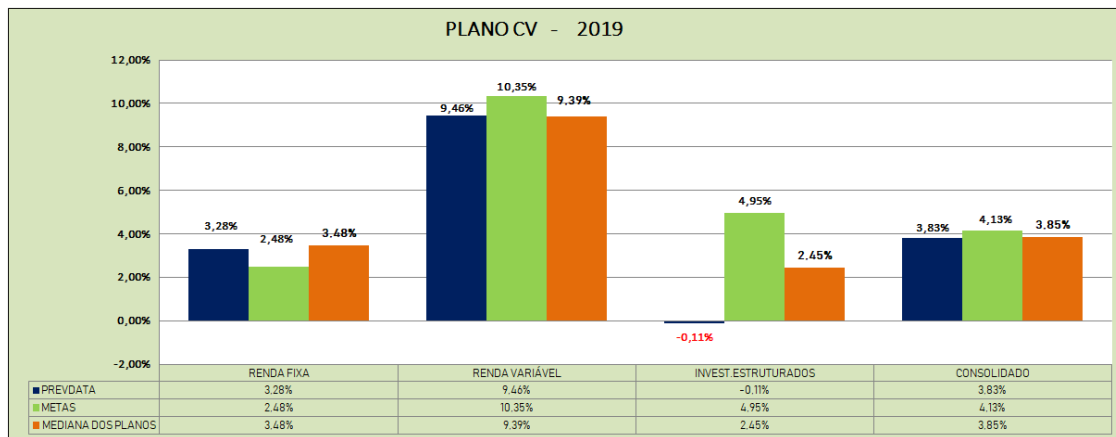
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

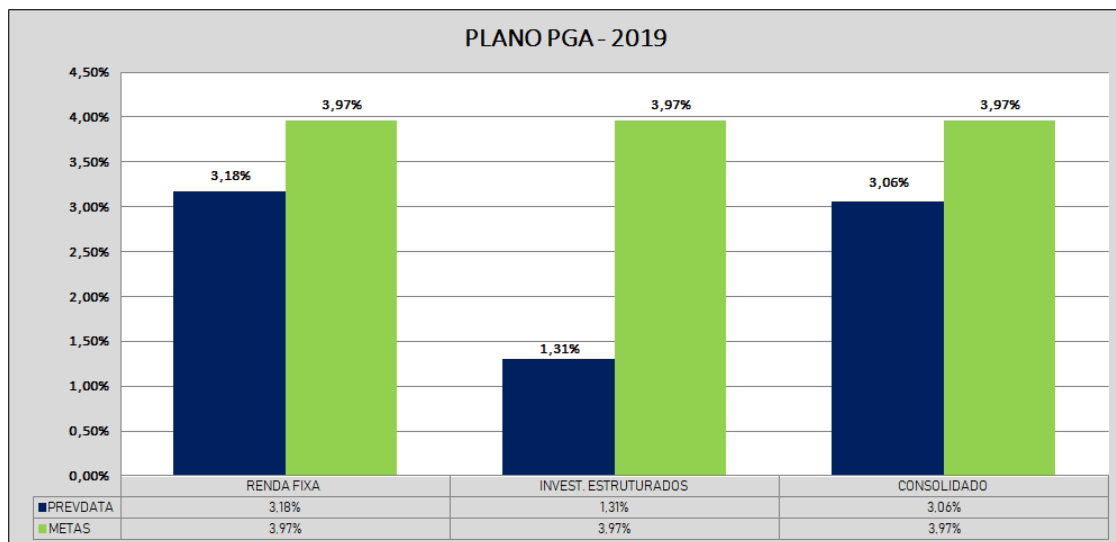
www.prevdata.org.br

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano CV:



Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



✓ Demonstração de Resultado até ABR/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	499.714,46	-40.193.888,67	32.829.626,62	-7.364.262,05

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\$ 40.194** deduzimos o valor de **R\$ 32.829**, referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como déficit técnico remanescente a quantia de **R\$ 7.364**, amplamente cobertos pelos demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 14.420**.

7

✓ RENTABILIDADE ACUMULADA DOS PLANOS:

PLANO PRV	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	4,13%	9,12%	7,94%	12,76%	17,73%	62,82%
CONSOLIDADO	3,64%	10,34%	12,39%	14,45%	14,73%	68,76%
RENTA FIXA	3,59%	9,65%	9,69%	14,02%	18,36%	68,14%
RENTA VARIÁVEL	8,72%	28,96%	49,39%	26,93%	-16,04%	123,20%
IMÓVEIS	3,18%	30,10%	10,87%	8,98%	33,14%	115,93%
EMPRÉSTIMOS	3,77%	12,66%	10,30%	16,93%	19,04%	79,47%
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,90%	8,05%	39,50%	15,33%	-15,92%	44,85%
PLANO CV	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	4,13%	9,12%	7,88%	12,66%	17,67%	62,51%
CONSOLIDADO	3,83%	10,04%	16,19%	18,01%	8,01%	69,20%
RENTA FIXA	3,28%	8,38%	11,17%	16,69%	23,55%	79,42%
RENTA VARIÁVEL	9,46%	21,58%	35,60%	24,87%	-8,60%	105,94%
EMPRÉSTIMOS	3,47%	12,50%	10,16%	16,74%	18,98%	78,11%
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,11%	5,59%	32,42%	18,52%	-8,23%	51,90%
PLANO PGA	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	3,97%	8,61%	7,68%	12,44%	17,40%	60,50%
CONSOLIDADO	3,06%	8,21%	10,11%	14,05%	15,78%	62,14%
RENTA FIXA	3,18%	8,59%	9,92%	14,04%	15,78%	62,60%
* INVEST. ESTRUTURADOS	1,31%	4,55%	18,98%	2,10%	-	28,67%
ÍNDICES	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
CDI	2,04%	6,42%	9,93%	14,00%	13,24%	54,09%
IBOVESPA	9,63%	15,04%	26,86%	38,94%	-13,31%	92,71%
IBRX	9,78%	15,42%	27,55%	36,70%	-12,41%	93,52%
INPC	0,60%	3,43%	2,07%	6,58%	11,24%	25,92%
IPCA	0,57%	3,75%	2,95%	6,29%	10,67%	26,35%
SELIC	0,52%	6,43%	9,94%	14,02%	13,27%	51,90%

* 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