

Relatório de Investimentos Junho – 2015

✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	2015
CONSOLIDADO	-0,59	2,63	1,53	2,24	0,43	1,17	7,62
RENDA FIXA	1,51	1,42	2,03	1,45	1,13	1,36	9,22
RENDA VARIÁVEL	-8,18	7,65	-0,38	8,83	-5,74	-1,01	0,00
IMÓVEIS	0,38	0,37	0,39	8,25	0,53	0,38	10,49
EMPRÉSTIMOS	1,21	1,28	2,05	1,74	2,06	1,36	10,09
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,42	1,85	0,49	-17,50	-0,40	4,90	-12,16
CDI	0,93	0,82	1,04	0,95	0,98	1,07	5,92
IBRX	-5,88	9,33	-0,51	9,12	-5,47	0,76	6,41
IBOVESPA	-6,20	9,97	-0,84	9,93	-6,17	0,61	6,15
TX. ATUARIAL (INPC + 5,80%)	1,96	1,64	1,99	1,18	1,47	1,24	9,86
PLANO CV	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	2015
CONSOLIDADO	0,01	2,07	0,79	1,85	0,69	0,63	6,18
RENDA FIXA	1,96	0,89	0,94	1,72	1,69	0,70	8,16
RENDA VARIÁVEL	-8,77	8,23	-0,37	7,11	-2,99	-0,00	2,21
EMPRESTIMOS	1,18	1,26	2,07	1,71	2,15	1,33	10,08
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,28	1,70	0,76	-10,88	0,11	1,31	-7,63
TX. ATUARIAL (INPC + 5,75%)	1,95	1,63	1,98	1,18	1,46	1,24	9,83
PLANO PGA	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	2015
CONSOLIDADO	1,49	1,19	1,42	1,06	1,26	1,12	7,78
RENDA FIXA	1,49	1,19	1,42	1,06	1,26	1,12	7,78
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	1,93	1,61	1,96	1,16	1,44	1,22	9,70

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

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENDA FIXA	516.016.146,00	82,31	143.172.466,62	69,17	15.913.203,11	100,00	675.101.815,73	79,44%
RENDA VARIÁVEL	59.037.690,87	9,42	40.148.745,70	19,40	0,00	0,00	99.186.436,57	11,67%
INVESTIMENTO ESTRUTURADO	10.730.491,71	1,71	10.480.019,37	5,06	0,00	0,00	21.210.511,08	2,50%
IMÓVEIS	4.776.542,40	0,76	0,00	0,00	0,00	0,00	4.776.542,40	0,56%
EMPRÉSTIMO	36.367.901,77	5,80	13.171.021,72	6,36	0,00	0,00	49.538.923,49	5,83%
TOTAL	626.928.772,75	100,00	206.972.253,41	100,00	15.913.203,11	100,00	849.814.229,27	100,00%

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV:

CONSOLIDADO	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	2015
MEDIANA PLANOS BD	1,09	1,58	1,43	1,57	0,87	1,07	7,85
PREVDATA BD	-0,59	2,63	1,53	2,24	0,43	1,17	7,62
MEDIANAS PLANOS CV	0,87	1,82	0,96	1,92	0,86	0,83	7,48
PREVDATA CV	0,01	2,07	0,79	1,85	0,69	0,63	6,18
RENDA FIXA							
MEDIANA PLANOS BD	1,62	1,25	1,65	1,28	1,21	1,16	8,45
PREVDATA BD - RF	1,51	1,42	2,03	1,45	1,13	1,36	9,22
MEDIANAS PLANOS CV	1,61	1,13	1,28	1,24	1,23	1,06	7,79
PREVDATA CV - RF	1,96	0,89	0,94	1,72	1,69	0,70	8,16
RENDA VARIÁVEL							
MEDIANA PLANOS BD	-6,16	6,84	-0,07	6,48	-4,16	0,32	2,57
PREVDATA BD - RV	-8,18	7,65	-0,38	8,83	-5,73	-1,01	0,00
MEDIANAS PLANOS CV	-6,01	7,45	-0,10	6,99	-4,33	0,35	3,63
PREVDATA CV - RV	-8,77	8,23	-0,37	7,10	-2,97	-0,00	2,21
INVEST. ESTRUTURADOS							
MEDIANA PLANOS BD	-0,12	0,51	-0,13	-0,23	0,11	-0,11	0,03
PREVDATA BD - IE	-0,42	1,85	0,49	-17,50	0,40	4,90	-12,16
MEDIANAS PLANOS CV	-0,26	0,23	-0,31	-0,20	0,22	-0,15	-0,47
PREVDATA CV - IE	-0,28	1,70	0,76	-10,88	0,11	1,31	-7,63

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

(Fonte RiskOffice)

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	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
TX. ATUARIAL (INPC + 5,80% aa)	9,86	12,38	11,63	12,57	55,13
CONSOLIDADO	7,62	7,26	6,67	12,80	38,89
RENDA FIXA	9,22	13,62	11,18	13,17	56,15
RENDA VARIÁVEL	0,00	-10,06	-6,02	7,60	-9,05
IMÓVEIS	10,49	4,13	3,26	117,63	158,56
EMPRÉSTIMOS	10,09	15,00	14,76	15,05	67,16
INVEST. ESTRUTURADOS	-12,16	2,94	8,61	12,76	10,74
PLANO CV	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
TX. ATUARIAL (INPC + 5,75% aa)	9,83	12,07	11,63	12,57	54,67
CONSOLIDADO	6,18	8,15	6,45	13,92	39,25
RENDA FIXA	8,16	13,23	9,84	12,87	51,83
RENDA VARIÁVEL	2,21	-8,56	-11,79	17,97	-2,74
EMPRÉSTIMOS	10,08	14,54	12,92	14,67	63,27
INVEST. ESTRUTURADOS	-7,63	2,96	4,74	3,04	2,64
PLANO PGA	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50% aa)	9,70	12,07	11,63	12,57	54,49
CONSOLIDADO	7,78	12,41	9,05	12,78	49,00
RENDA FIXA	7,78	12,41	9,05	12,78	49,00
ÍNDICES	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
CDI	5,92	10,81	8,06	8,39	37,47
IBRX	6,41	-2,78	-3,14	11,55	11,78
IBOVESPA	6,15	-2,91	-15,51	7,38	-6,50

✓ Demonstração de Resultado até Jun/15:

DEMONSTRAÇÃO CONTÁBIL -		PLANO PRV	DEMONSTRAÇÃO ATIVO LÍQUIDO	
Exercício	Superávit/Déficit	Resultado Acum.	Ajuste Precificação NTN-B	Resultado Final
2011	3.430.083,00	3.430.083,00	-	-
2012	6.604.350,47	10.034.433,47	-	-
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	36.078.601,62	-3.709.116,16		6.401.777,41

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

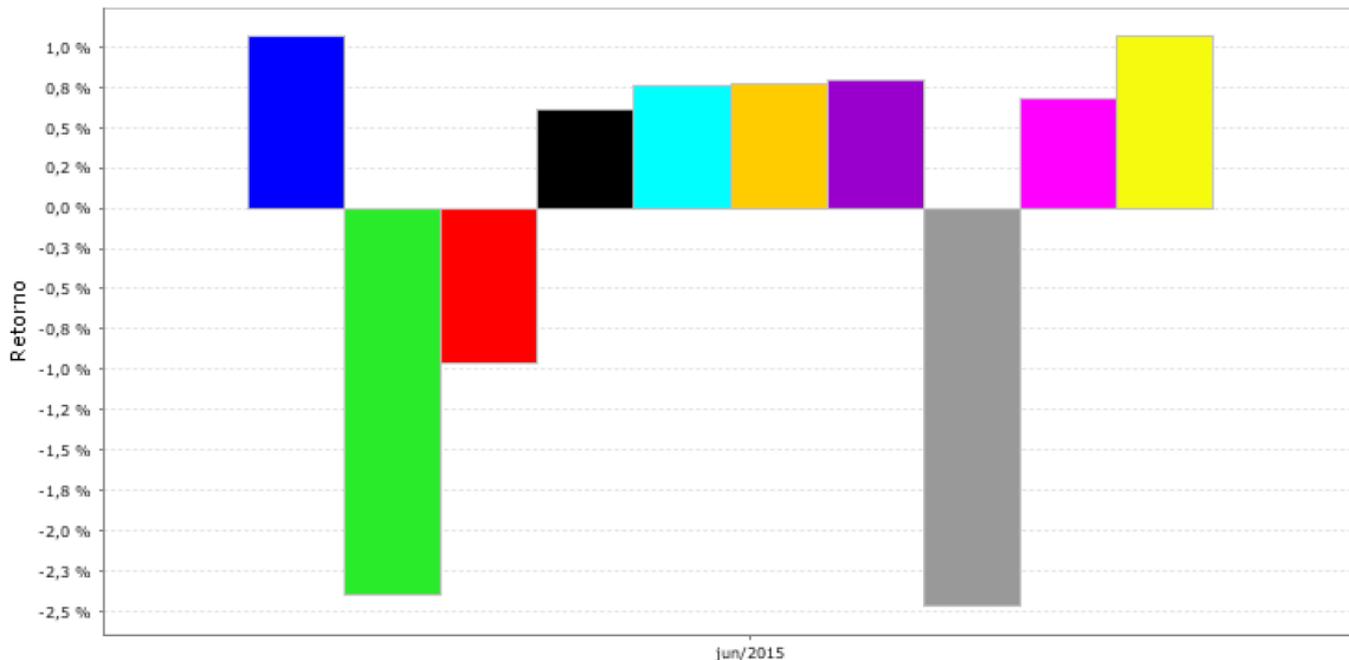
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br

Retorno efetivo mensal de Jun/2015 até Jun/2015 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
CDI	1,07 %	5,92 %	1,07 %	1,07 %
Dólar	-2,40 %	16,81 %	-2,40 %	-2,40 %
Euro	-0,97 %	7,23 %	-0,97 %	-0,97 %
Ibovespa	0,61 %	6,15 %	0,61 %	0,61 %
IBX	0,76 %	6,41 %	0,76 %	0,76 %
INPC	0,77 %	6,80 %	0,77 %	0,77 %
IPCA	0,79 %	6,17 %	0,79 %	0,79 %
Ouro	-2,47 %	17,25 %	-2,47 %	-2,47 %
Poupança	0,68 %	3,70 %	0,68 %	0,68 %
Selic	1,07 %	5,94 %	1,07 %	1,07 %

*A data usada para o cálculo foi 30/06/2015.

(Fonte Quantum)

Renda Fixa – Investimentos Estruturados

Rafael Bittencourt 2112.7661 - rafael@prevdata.org.br

Renda Variável - Coordenação de Investimentos

Mozart Donato 2112.7670 - donato@prevdata.org.br

Diretoria de Administração e Finanças

Carlos Eduardo 2112.7653 - eduardo@prevdata.org.br