

## Relatório de Investimentos

### Julho – 2020

#### ✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

| SEGMENTOS                   | PLANO PRV      | % S/PL | PLANO CV       | % S/PL | PLANO PGA     | % S/PL | CONSOLIDADO      | % S/PL |
|-----------------------------|----------------|--------|----------------|--------|---------------|--------|------------------|--------|
| RENTA FIXA                  | 705.803.886,95 | 71,2%  | 344.345.873,12 | 54,79% | 35.240.453,54 | 84,04% | 1.085.390.213,61 | 65,32% |
| ESTRUTURADOS                | 131.934.959,85 | 13,31% | 79.306.268,18  | 12,62% | 4.886.351,13  | 11,65% | 216.127.579,16   | 13,01% |
| RENTA VARIÁVEL              | 122.134.757,03 | 12,32% | 170.968.385,89 | 27,21% | 1.806.847,61  | 4,31%  | 294.909.990,53   | 17,75% |
| EXTERIOR                    | 0,00           | 0,00%  | 0,00           | 0,00%  | 0,00          | 0,00%  | 0,00             | 0,00%  |
| IMOBILIÁRIOS                | 4.339.609,58   | 0,44%  | 0,00           | 0,00%  | 0,00          | 0,00%  | 4.339.609,58     | 0,26%  |
| OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | 27.130.683,05  | 2,74%  | 33.821.554,75  | 5,38%  | 0,00          | 0,00%  | 60.952.237,80    | 3,67%  |
| TOTAL                       | 991.343.896,46 | 100,0% | 628.442.081,94 | 100,0% | 41.933.652,28 | 100,0% | 1.661.719.630,68 | 100,0% |
| PL MÊS ANTERIOR             | 948.581.136,80 |        | 586.130.051,47 |        | 39.957.254,91 |        | 1.574.668.443,18 |        |

| Plano PRV - Renda Fixa                       |                       |                         |                     |                     |                    |                     |                     |                    |                |         |
|----------------------------------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|----------------|---------|
| ATIVOS                                       | Rentabilidade Janeiro | Rentabilidade Fevereiro | Rentabilidade Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio     | % Ativo |
| Debêntures VALE                              | 4,62%                 | 3,84%                   | -7,94%              | 10,18%              | 1,87%              | 0,83%               | 1,10%               | 14,43%             | 176.209,87     | 0,02%   |
| Fundo Crédito - Emissão Prim. II             | -16,30%               | -10,58%                 | -8,16%              | -11,60%             | -17,20%            | 2001,97%            | -21,56%             | 729,54%            | 0,00           | 0,00%   |
| Fundo Crédito - Western Structured II        | 0,49%                 | 0,37%                   | 0,45%               | 0,66%               | 0,09%              | 0,56%               | 0,23%               | 2,88%              | 10.056.753,31  | 1,01%   |
| *Fundo Crédito Pátria Mezanino               | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | 0,07%               | 0,86%               | 0,93%              | 1.578.627,86   | 0,16%   |
| Fundo Cx - AZ Quest Luce                     | 0,46%                 | 0,25%                   | -5,60%              | -0,11%              | 0,67%              | 0,98%               | 1,57%               | -1,94%             | 25.627.481,52  | 2,59%   |
| Fundo Cx - AF Invest FI RF CP                | 0,42%                 | 0,29%                   | -1,85%              | -1,64%              | -0,09%             | 0,29%               | 0,37%               | -2,22%             | 0,00           | 0,00%   |
| Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.           | 0,46%                 | 0,26%                   | -4,27%              | 0,53%               | 0,59%              | 0,59%               | 0,75%               | -1,19%             | 1.062.760,81   | 0,11%   |
| Fundo Cx - BNP Paribas Match DI              | 0,36%                 | 0,28%                   | 0,23%               | -0,15%              | 0,17%              | -0,01%              | 0,14%               | 1,02%              | 9.220.437,40   | 0,93%   |
| Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP          | 0,37%                 | 0,29%                   | -0,72%              | 0,28%               | 0,40%              | 0,23%               | 0,44%               | 1,29%              | 14.978.616,12  | 1,51%   |
| **Fundo Western Asset IMA B                  | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 2,04%               | 2,04%              | 5.204.288,31   | 0,52%   |
| ***Fundo Icatu Vanguarda Infl Longa FI RF LP | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 0,00%               | 0,00%              | 10.340.000,00  | 1,04%   |
| Letra Finan.                                 | 1,36%                 | 0,54%                   | 0,80%               | 0,40%               | 0,08%              | 0,48%               | 0,90%               | 4,64%              | 39.199.889,02  | 3,95%   |
| Título Público - NTN-B                       | 1,32%                 | 0,54%                   | 0,77%               | 0,39%               | 0,07%              | 0,50%               | 0,88%               | 4,55%              | 588.358.822,73 | 59,35%  |
| RENTA FIXA                                   | 1,21%                 | 0,52%                   | 0,41%               | 0,33%               | 0,10%              | 0,49%               | 0,88%               | 4,00%              | 705.803.886,95 | 71,20%  |
| META ATUARIAL (INPC+ 5,10% a.a.)             | 0,61%                 | 0,59%                   | 0,60%               | 0,18%               | 0,16%              | 0,72%               | 0,86%               | 3,77%              |                |         |

\*início em 24/06/20

\*\*início em 23/07/20

\*\*\*início em 31/07/20

**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 Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio     | % Ativo |
| Fundo Crédito - Emissão Prim. II             | -16,30%               | -10,58%                 | -8,17%              | -11,58%             | -17,20%            | 2001,81%            | -21,56%             | 729,58%            | 0,00           | 0,00%   |
| Fundo Crédito - Western Structured II        | 0,49%                 | 0,37%                   | 0,45%               | 0,66%               | 0,09%              | 0,56%               | 0,23%               | 2,88%              | 8.178.019,17   | 1,30%   |
| *Fundo Crédito Pátria Mezanino               | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | 0,07%               | 0,86%               | 0,93%              | 1.288.943,59   | 0,21%   |
| Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.           | 0,46%                 | 0,26%                   | -4,27%              | 0,53%               | 0,59%              | 0,59%               | 0,75%               | -1,19%             | 29.166.598,43  | 4,64%   |
| Fundo Cx - BNP Paribas Match DI              | 0,36%                 | 0,28%                   | 0,23%               | -0,15%              | 0,17%              | -0,01%              | 0,14%               | 1,02%              | 33.089.381,77  | 5,27%   |
| Fundo Cx - AZ Quest Luce                     | 0,46%                 | 0,25%                   | -5,60%              | -0,11%              | 0,67%              | 0,98%               | 1,57%               | -1,94%             | 32.018.264,96  | 5,09%   |
| Fundo Cx - AF Invest FI RF CP                | 0,42%                 | 0,29%                   | -1,85%              | -1,64%              | -0,09%             | 0,29%               | 0,37%               | -2,22%             | 0,00           | 0,00%   |
| Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP          | 0,37%                 | 0,29%                   | -0,72%              | 0,28%               | 0,40%              | 0,23%               | 0,44%               | 1,29%              | 45.158.546,51  | 7,19%   |
| **Fundo Western Asset IMA B                  | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 2,04%               | 2,04%              | 31.429.819,57  | 5,00%   |
| ***Fundo Icatu Vanguarda Infl Longa FI RF LP | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 0,00%               | 0,00%              | 12.770.000,00  | 2,03%   |
| Letra Finan.                                 | 1,28%                 | 0,54%                   | 0,80%               | 0,38%               | 0,07%              | 0,54%               | 0,91%               | 4,60%              | 15.554.371,57  | 2,48%   |
| Título Público - NTN-B                       | 0,74%                 | 0,53%                   | -2,35%              | 0,65%               | 0,97%              | 1,20%               | 1,73%               | 3,47%              | 135.691.927,55 | 21,59%  |
| RENTA FIXA                                   | 0,58%                 | 0,49%                   | -2,22%              | 0,16%               | 0,57%              | 0,75%               | 1,28%               | 1,60%              | 344.345.873,12 | 54,79%  |
| META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)   | 0,59%                 | 0,57%                   | 0,58%               | 0,17%               | 0,15%              | 0,70%               | 0,84%               | 3,65%              |                |         |

\*início em 24/06/20

\*\*início em 23/07/20

\*\*\*início em 31/07/20

| PGA - Renda Fixa                      |                       |                         |                     |                     |                    |                     |                     |                    |               |         |
|---------------------------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------|---------|
| ATIVOS                                | Rentabilidade Janeiro | Rentabilidade Fevereiro | Rentabilidade Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio    | % Ativo |
| Fundo Crédito - Emissão Prim. II      | -16,32%               | -10,57%                 | -8,11%              | -11,70%             | -17,13%            | 2002,11%            | -21,56%             | 729,71%            | 0,00          | 0,00%   |
| Fundo Crédito - Western Structured II | 0,49%                 | 0,37%                   | 0,45%               | 0,66%               | 0,09%              | 0,56%               | 0,23%               | 2,88%              | 580.197,31    | 1,38%   |
| *Fundo Crédito Pátria Mezanino        | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | 0,07%               | 0,86%               | 0,93%              | 89.832,40     | 0,21%   |
| Fundo Cx - AZ Quest Luce              | 0,46%                 | 0,25%                   | -5,60%              | -0,11%              | 0,67%              | 0,98%               | 1,57%               | -1,94%             | 3.182.792,74  | 7,59%   |
| Fundo Cx - AF Invest FI RF CP         | 0,42%                 | 0,29%                   | -1,85%              | -1,64%              | -0,09%             | 0,29%               | 0,37%               | -2,22%             | 0,00          | 0,00%   |
| Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.    | 0,46%                 | 0,26%                   | -4,27%              | 0,53%               | 0,59%              | 0,59%               | 0,75%               | -1,19%             | 2.761.644,72  | 6,59%   |
| Fundo Cx - BNP Paribas Match DI       | 0,36%                 | 0,28%                   | 0,23%               | -0,15%              | 0,17%              | -0,01%              | 0,14%               | 1,02%              | 1.485.743,13  | 3,54%   |
| Fundo Cx - Votorantim Inst FI RF CP   | 0,37%                 | 0,29%                   | -0,72%              | 0,28%               | 0,40%              | 0,23%               | 0,44%               | 1,29%              | 3.525.899,13  | 8,41%   |
| **Fundo Western Asset IMA B           | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 2,04%               | 2,04%              | 1.836.807,64  | 4,38%   |
| Título Público - NTN-B                | 1,11%                 | 0,52%                   | 1,34%               | 0,55%               | 0,29%              | 0,85%               | 1,58%               | 6,40%              | 21.777.536,47 | 51,93%  |
| RENTA FIXA                            | 0,79%                 | 0,40%                   | -0,27%              | 0,23%               | 0,31%              | 0,70%               | 1,35%               | 3,56%              | 35.240.453,54 | 84,04%  |
| META ATUARIAL (INPC + 4,50% a.a.)     | 0,56%                 | 0,54%                   | 0,55%               | 0,14%               | 0,12%              | 0,67%               | 0,81%               | 3,42%              |               |         |

\*início em 24/06/20

\*\*início em 23/07/20

**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 PRV - Renda Variável         |                         |         |           |         |        |       |        |        |              |                |            |
|------------------------------------|-------------------------|---------|-----------|---------|--------|-------|--------|--------|--------------|----------------|------------|
| Renda Variável PRV Saldado         | Estratégia              | Janeiro | Fevereiro | Março   | Abril  | Mai   | Junho  | Julho  | Rentab. 2020 | Patrimônio     | % sobre PL |
| BOGARI VALUE FIC AÇÕES             | Ações Valor Crescimento | 2,34%   | -5,83%    | -30,04% | 10,55% | 8,04% | 12,07% | 10,96% | 0,14%        | 27.948.967,73  | 2,82%      |
| PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA    | Ações Livres            | 6,08%   | -5,73%    | -35,31% | 14,30% | 8,49% | 18,02% | 6,77%  | 1,08%        | 38.428.774,18  | 3,88%      |
| BRASECO DIVIDENDOS FI AÇÕES        | Ações Dividendos        | -2,72%  | -8,40%    | -27,45% | 7,25%  | 6,42% | 3,36%  | -      | -23,73%      | 0,00           | 0,00%      |
| SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES | Índice Ativo            | -0,98%  | -8,98%    | -33,16% | 11,33% | 7,94% | 4,42%  | -      | -24,41%      | 0,00           | 0,00%      |
| OCCAM FIC AÇÕES                    | Ações Valor Crescimento | 0,95%   | -9,52%    | -27,02% | 10,22% | 8,29% | 8,97%  | 10,36% | -4,32%       | 7.151.188,35   | 0,72%      |
| BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES | Ações Livres            | 0,79%   | -8,06%    | -32,70% | 11,65% | 8,04% | 7,66%  | 11,99% | -9,30%       | 0,00           | 0,00%      |
| **FATOR SINERGIA FIA               | Ações Livres            | -       | -         | -       | -      | -     | 3,41%  | 14,23% | 18,13%       | 15.716.609,78  | 1,59%      |
| **MOAT CAPITAL FIC AÇÕES           | Índice Ativo            | -       | -         | -       | -      | -     | -0,75% | 12,57% | 11,73%       | 32.889.196,99  | 3,32%      |
| *ETF BOVA 11                       | Índice Passivo          | -       | -         | -21,25% | 11,33% | 8,99% | 8,88%  | 10,73% | 15,20%       | 0,00           | 0,00%      |
| RENDA VARIÁVEL                     |                         | 1,71%   | -7,28%    | -32,00% | 11,47% | 8,03% | 11,43% | 9,65%  | -5,65%       | 122.134.737,03 | 12,32%     |
| META DE GESTÃO (Ibovespa)          |                         | -1,63%  | -8,43%    | -29,90% | 10,25% | 8,57% | 8,76%  | 8,27%  | -11,00%      |                |            |

\* Início em março 2020

\*\* Início em Junho 2020

| Plano CV - Renda Variável          |                         |         |           |         |        |       |        |        |              |                |            |
|------------------------------------|-------------------------|---------|-----------|---------|--------|-------|--------|--------|--------------|----------------|------------|
| Renda Variável Plano CV            | Estratégia              | Janeiro | Fevereiro | Março   | Abril  | Mai   | Junho  | Julho  | Rentab. 2020 | Patrimônio     | % sobre PL |
| BAHIA AM SMID CAPS VALOR FIC AÇÕES | Ações Livre             | 0,79%   | -8,06%    | -32,70% | 11,65% | 8,04% | 7,66%  | 11,99% | -9,30%       | 0,00           | 0,00%      |
| OCEANA VALOR FIC AÇÕES             | Índice Ativo            | -2,02%  | -7,47%    | -28,88% | 11,43% | 6,62% | 6,43%  | -      | -18,47%      | 0,00           | 0,00%      |
| OCCAM FIC AÇÕES                    | Ações Valor Crescimento | 0,95%   | -9,52%    | -27,02% | 10,22% | 8,29% | 8,97%  | 10,18% | -4,47%       | 9.985.290,45   | 1,59%      |
| BOGARI VALUE FIC AÇÕES             | Ações Valor Crescimento | 2,34%   | -5,83%    | -30,04% | 10,55% | 8,04% | 12,07% | 10,94% | 0,12%        | 31.892.709,14  | 5,07%      |
| XP INVESTOR FI AÇÕES               | Índice Ativo            | 3,18%   | -5,88%    | -38,17% | 14,71% | 9,82% | 9,26%  | 8,64%  | -10,21%      | 20.655.637,91  | 3,29%      |
| PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA    | Ações Livres            | 6,08%   | -5,73%    | -35,31% | 14,30% | 8,49% | 18,02% | 6,77%  | 1,08%        | 59.594.607,67  | 9,48%      |
| BRASECO DIVIDENDOS FI AÇÕES        | Ações Dividendos        | -2,72%  | -8,40%    | -27,45% | 7,25%  | 6,42% | 3,36%  | -      | -23,73%      | 0,00           | 0,00%      |
| SANTANDER IBOV ATIVO INST FI AÇÕES | Índice Ativo            | -0,98%  | -8,98%    | -33,16% | 11,33% | 7,94% | 4,42%  | -      | -24,41%      | 0,00           | 0,00%      |
| **FATOR SINERGIA FIA               | Ações Livres            | -       | -         | -       | -      | -     | 3,41%  | 14,23% | 18,13%       | 20.501.877,44  | 3,26%      |
| **MOAT CAPITAL FIC AÇÕES           | Índice Ativo            | -       | -         | -       | -      | -     | -0,75% | 12,57% | 11,73%       | 28.338.263,28  | 4,51%      |
| *ETF BOVA 11                       | Índice Passivo          | -       | -         | -21,25% | 11,33% | 8,99% | 8,88%  | 10,73% | 15,20%       | 0,00           | 0,00%      |
| RENDA VARIÁVEL                     |                         | 2,27%   | -6,77%    | -32,50% | 11,98% | 8,16% | 12,13% | 9,22%  | -4,54%       | 170.968.385,89 | 27,21%     |
| META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)  |                         | -1,47%  | -8,28%    | -29,78% | 10,43% | 8,75% | 8,94%  | 8,45%  | -9,96%       |                |            |

\* Início em março 2020

\*\* Início em Junho 2020

**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

4

| Plano PGA - Renda Variável |                         |         |           |         |        |       |        |        |              |              |            |
|----------------------------|-------------------------|---------|-----------|---------|--------|-------|--------|--------|--------------|--------------|------------|
| Renda Variável PRV Saldado | Estratégia              | Janeiro | Fevereiro | Março   | Abril  | Maio  | Junho  | Julho  | Rentab. 2020 | Patrimônio   | % sobre PL |
| BOGARI VALUE FIC AÇÕES     | Ações Valor Crescimento | 2,34%   | -5,83%    | -30,04% | 10,55% | 8,04% | 12,07% | 10,77% | -0,03%       | 988.367,61   | 2,36%      |
| **MOAT CAPITAL FIC AÇÕES   | Índice Ativo            | -       | -         | -       | -      | -     | -      | 0,00%  | 0,00%        | 818.480,00   | 1,95%      |
| ETF BOVA 11                | Índice Passivo          | -       | -         | -21,75% | 11,33% | 8,99% | 8,88%  | 10,73% | 14,47%       | 0,00         | 0,00%      |
| RENDA VARIÁVEL             |                         | 2,34%   | -5,83%    | -30,00% | 11,26% | 8,90% | 9,17%  | 10,73% | -1,18%       | 1.806.847,61 | 4,31%      |
| META DE GESTÃO (Ibovespa)  |                         | -1,63%  | -8,43%    | -29,90% | 10,25% | 8,57% | 8,76%  | 8,27%  | -11,00%      |              | -          |

\* Início em março 2020

\*\* Início em 31 de julho de 2020

| Plano PRV - Investimentos Estruturados |                       |                         |                     |                     |                    |                     |                     |                    |                |         |
|----------------------------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|----------------|---------|
| ATIVOS                                 | Rentabilidade Janeiro | Rentabilidade Fevereiro | Rentabilidade Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio     | % Ativo |
| FIP Hamilton Lane                      | 3,27%                 | -3,16%                  | -1,11%              | 2,85%               | -1,58%             | 2,15%               | 4,89%               | 7,26%              | 7.868.473,45   | 0,79%   |
| FIP Kinea                              | -10,51%               | 13,56%                  | 0,60%               | -0,13%              | -0,08%             | -0,10%              | -0,04%              | 1,88%              | 5.681.497,23   | 0,57%   |
| FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III   | -1,13%                | 0,03%                   | 2,88%               | -0,48%              | -0,04%             | -0,75%              | 0,17%               | 0,63%              | 10.170.720,18  | 1,03%   |
| FIP Brasil Energia Renovável           | 0,02%                 | -0,07%                  | -0,10%              | -0,16%              | -0,08%             | -8,09%              | -0,10%              | -8,54%             | 1.518.128,80   | 0,15%   |
| FMM IBIUNA Hedge                       | 0,18%                 | 2,13%                   | 3,26%               | 2,81%               | 0,63%              | 0,94%               | 2,80%               | 13,42%             | 41.863.798,09  | 4,22%   |
| FMM MAUÁ Macro                         | 1,65%                 | -0,83%                  | -1,67%              | 0,10%               | 0,94%              | 1,55%               | -                   | 1,71%              | 0,00           | 0,00%   |
| FMM BAHIA MARAÚ                        | -0,18%                | -0,95%                  | -6,54%              | 0,03%               | 0,87%              | 1,07%               | 1,75%               | -4,12%             | 10.716.989,74  | 1,08%   |
| FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO            | -0,18%                | -0,95%                  | -6,54%              | 0,03%               | 0,86%              | 1,07%               | 1,75%               | -4,13%             | 15.456.216,10  | 1,56%   |
| FMM AZ QUEST Multi                     | 0,75%                 | 0,88%                   | -3,11%              | 0,63%               | 1,17%              | 0,42%               | 1,19%               | 1,87%              | 23.502.063,65  | 2,37%   |
| FMM GAP MULTIPORTFOLIO                 | -0,78%                | -2,39%                  | 0,67%               | 4,31%               | 5,24%              | 1,24%               | 1,48%               | 9,96%              | 3.408.617,36   | 0,34%   |
| FMM SUL AMÉRICA ENDURANCE              | 0,04%                 | -0,09%                  | -0,62%              | 0,16%               | 0,31%              | 0,00%               | -                   | -0,20%             | 0,00           | 0,00%   |
| *FMM VISTA MULTIESTRATÉGIA             | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 3,06%               | 3,06%              | 11.748.455,25  | 1,19%   |
| INVESTIMENTO ESTRUTURADOS              | 0,57%                 | 0,34%                   | -1,40%              | 0,78%               | 0,69%              | 0,75%               | 2,08%               | 3,84%              | 131.934.959,85 | 13,31%  |
| META ATUARIAL (INPC + 5,10% a.a.)      | 0,61%                 | 0,59%                   | 0,60%               | 0,18%               | 0,16%              | 0,72%               | 0,86%               | 3,77%              |                |         |

\* Início 02/07/20

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 - Investimentos Estruturados      |                       |                         |                     |                     |                    |                     |                     |                    |               |         |
|--------------------------------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------|---------|
| ATIVOS                                     | Rentabilidade Janeiro | Rentabilidade Fevereiro | Rentabilidade Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio    | % Ativo |
| FIP Hamilton Lane                          | 3,27%                 | -3,16%                  | -1,11%              | 2,85%               | -1,58%             | 2,15%               | 4,89%               | 7,26%              | 2.622.824,45  | 0,42%   |
| FIP Kinea                                  | -10,51%               | 13,56%                  | 0,60%               | -0,13%              | -0,08%             | -0,10%              | -0,04%              | 1,88%              | 2.840.729,94  | 0,45%   |
| FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III       | -1,13%                | 0,03%                   | 2,88%               | -0,48%              | -0,04%             | -0,75%              | 0,17%               | 0,63%              | 2.033.214,47  | 0,32%   |
| FIP Brasil Energia Renovável               | 0,02%                 | -0,07%                  | -0,10%              | -0,16%              | -0,08%             | -8,09%              | -0,10%              | -8,54%             | 910.877,29    | 0,14%   |
| FMM IBIUNA Hedge                           | 0,18%                 | 2,13%                   | 3,26%               | 2,81%               | 0,63%              | 0,94%               | 2,80%               | 13,42%             | 26.233.971,08 | 4,17%   |
| FMM MAUÁ Macro                             | 1,65%                 | -0,83%                  | -1,67%              | 0,10%               | 0,94%              | 1,55%               | 0,00%               | 1,71%              | 0,00          | 0,00%   |
| FMM BAHIA MARAÚ                            | -0,18%                | -0,95%                  | -6,54%              | 0,03%               | 0,87%              | 1,07%               | 1,75%               | -4,12%             | 9.565.408,52  | 1,52%   |
| FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO                | -0,18%                | -0,95%                  | -6,54%              | 0,03%               | 0,86%              | 1,07%               | 1,75%               | -4,13%             | 6.193.135,84  | 0,99%   |
| FMM AZ QUEST MULTI FIM                     | 0,75%                 | 0,88%                   | -3,11%              | 0,63%               | 1,17%              | 0,42%               | 1,19%               | 1,87%              | 15.580.390,72 | 2,48%   |
| FMM GAP MULTIPORTFOLIO                     | -0,78%                | -2,39%                  | 0,67%               | 4,31%               | 5,24%              | 1,24%               | 1,48%               | 9,96%              | 5.493.412,37  | 0,87%   |
| *FMM VISTA MULTISTRATÉGIA                  | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 3,06%               | 3,06%              | 7.832.303,50  | 1,25%   |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS                 | 0,54%                 | 0,35%                   | -1,54%              | 1,07%               | 1,03%              | 0,89%               | 2,09%               | 4,49%              | 79.306.268,18 | 12,62%  |
| META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.) | 0,59%                 | 0,57%                   | 0,58%               | 0,17%               | 0,15%              | 0,70%               | 0,84%               | 3,65%              |               | 100,00% |

\*Início 02/07/20

| Plano PGA - Investimentos Estruturados |                       |                         |                     |                     |                    |                     |                     |                    |              |         |
|----------------------------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|--------------|---------|
| ATIVOS                                 | Rentabilidade Janeiro | Rentabilidade Fevereiro | Rentabilidade Março | Rentabilidade Abril | Rentabilidade Maio | Rentabilidade Junho | Rentabilidade Julho | Rentabilidade 2020 | Patrimônio   | % Ativo |
| FMM IBIUNA Hedge                       | 0,18%                 | 2,13%                   | 3,26%               | 2,81%               | 0,63%              | 0,94%               | 2,80%               | 13,42%             | 2.198.776,05 | 5,24%   |
| FMM MAUÁ Macro                         | 1,65%                 | -0,83%                  | -1,67%              | 0,10%               | 0,94%              | 1,55%               | 0,00%               | 1,71%              | 0,00         | 0,00%   |
| FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO            | -0,18%                | -0,95%                  | -6,54%              | 0,03%               | 0,86%              | 1,07%               | 1,75%               | -4,13%             | 956.034,76   | 2,28%   |
| FMM AZ QUEST MULTI FIM                 | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | 0,53%               | 1,19%               | 1,73%              | 722.279,44   | 1,72%   |
| FMM GAP MULTIPORTFOLIO                 | -0,78%                | -2,39%                  | 0,67%               | 4,31%               | 5,24%              | 1,24%               | 1,48%               | 9,96%              | 277.558,04   | 0,66%   |
| *FMM VISTA MULTISTRATÉGIA              | -                     | -                       | -                   | -                   | -                  | -                   | 3,06%               | 3,06%              | 731.702,04   | 1,74%   |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS             | 0,59%                 | 0,47%                   | 0,63%               | 1,82%               | 1,14%              | 2,74%               | 2,34%               | 10,12%             | 4.886.350,33 | 9,91%   |
| META GESTÃO (INPC + 4,50% a.a.)        | 0,56%                 | 0,54%                   | 0,55%               | 0,14%               | 0,12%              | 0,67%               | 0,81%               | 3,42%              | -            | -       |

## ✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

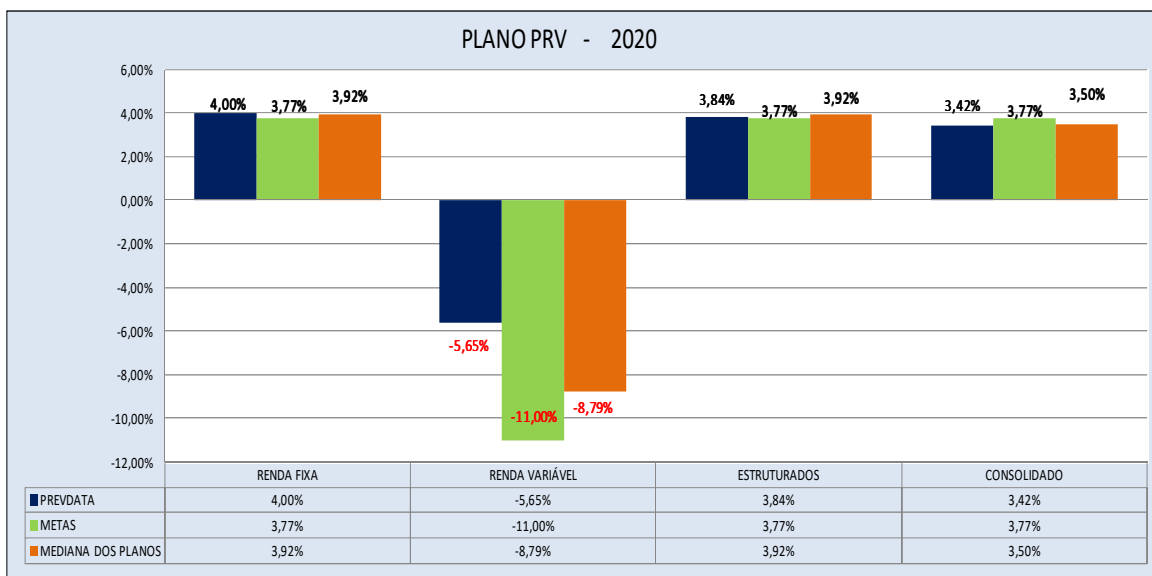
| PLANO PRV                    | 01/20  | 02/20  | 03/20   | 04/20  | 05/20 | 06/20  | 07/20 | 2020    |
|------------------------------|--------|--------|---------|--------|-------|--------|-------|---------|
| CONSOLIDADO                  | 1,19%  | -0,49% | -4,00%  | 1,47%  | 1,03% | 1,68%  | 2,65% | 3,42%   |
| RENTA FIXA                   | 1,21%  | 0,52%  | 0,41%   | 0,33%  | 0,10% | 0,49%  | 0,88% | 4,00%   |
| RENTA VARIÁVEL               | 1,71%  | -7,28% | -32,00% | 11,47% | 8,03% | 11,43% | 9,65% | -5,65%  |
| IMOBILIÁRIO                  | 0,56%  | 0,57%  | 0,65%   | 0,65%  | 0,67% | 0,63%  | 0,66% | 4,46%   |
| OPER. PARTICIPANTES          | 1,19%  | 1,91%  | 0,86%   | 0,83%  | 0,85% | 0,61%  | 0,63% | 7,09%   |
| ESTRUTURADOS                 | 0,57%  | 0,34%  | -1,40%  | 0,78%  | 0,69% | 0,75%  | 2,08% | 3,84%   |
| CDI                          | 0,38%  | 0,29%  | 0,34%   | 0,28%  | 0,24% | 0,21%  | 0,19% | 1,95%   |
| IBOVESPA                     | -1,63% | -8,43% | -29,90% | 10,25% | 8,57% | 8,76%  | 8,27% | -11,00% |
| META ATUARIAL (INPC + 5,10%) | 0,61%  | 0,59%  | 0,60%   | 0,18%  | 0,16% | 0,72%  | 0,86% | 3,77%   |

| PLANO CV                     | 01/20 | 02/20  | 03/20   | 04/20  | 05/20 | 06/20  | 07/20 | 2020   |
|------------------------------|-------|--------|---------|--------|-------|--------|-------|--------|
| CONSOLIDADO                  | 1,10% | -1,60% | -10,78% | 3,00%  | 2,50% | 3,56%  | 3,63% | 0,56%  |
| RENTA FIXA                   | 0,58% | 0,49%  | -2,22%  | 0,16%  | 0,57% | 0,75%  | 1,28% | 1,60%  |
| RENTA VARIÁVEL               | 2,27% | -6,77% | -32,50% | 11,98% | 8,16% | 12,13% | 9,22% | -4,54% |
| OPER. PARTICIPANTES          | 1,19% | 1,88%  | 0,85%   | 0,80%  | 0,78% | 0,59%  | 0,59% | 6,88%  |
| ESTRUTURADOS                 | 0,54% | 0,35%  | -1,54%  | 1,07%  | 1,03% | 0,89%  | 2,09% | 4,49%  |
| META ATUARIAL (INPC + 4,90%) | 0,59% | 0,57%  | 0,58%   | 0,17%  | 0,15% | 0,70%  | 0,84% | 3,65%  |

| PLANO PGA                     | 01/20 | 02/20  | 03/20   | 04/20  | 05/20 | 06/20 | 07/20  | 2020   |
|-------------------------------|-------|--------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|
| CONSOLIDADO                   | 0,78% | 0,38%  | -1,13%  | 0,69%  | 0,67% | 1,22% | 1,64%  | 4,31%  |
| RENTA FIXA                    | 0,79% | 0,40%  | -0,27%  | 0,23%  | 0,31% | 0,70% | 1,35%  | 3,56%  |
| RENTA VARIÁVEL                | 2,34% | -5,83% | -30,00% | 11,26% | 8,90% | 9,17% | 10,73% | -1,18% |
| ESTRUTURADOS                  | 0,59% | 0,47%  | 0,63%   | 1,82%  | 1,14% | 2,74% | 2,34%  | 10,12% |
| META DE GESTÃO (INPC + 4,50%) | 0,56% | 0,54%  | 0,55%   | 0,14%  | 0,12% | 0,67% | 0,81%  | 3,42%  |

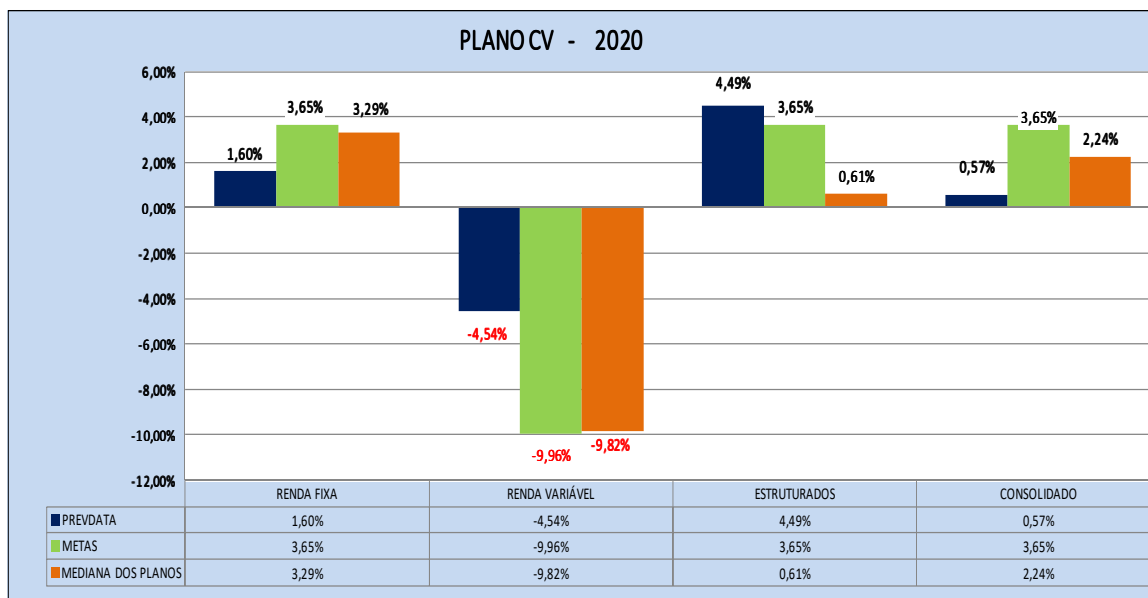
\* Rent. auferidas pelo Ger de Investimentos, antes do fechamento contábil.

## ✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV



Mediana dos Planos - Base comparativa Relatório ADITUS

## ✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano CV:



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

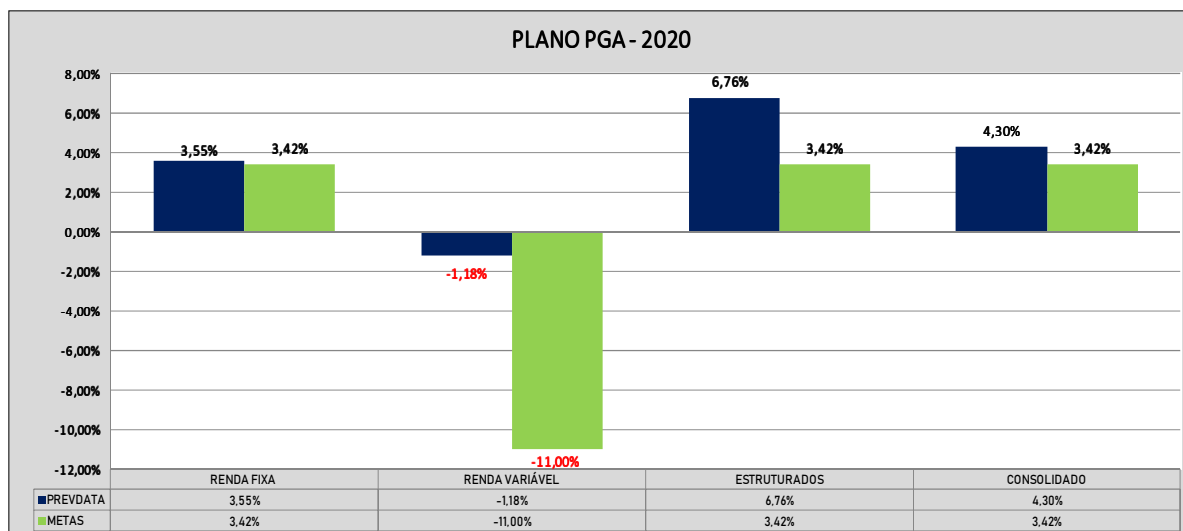
Centro | Rio de Janeiro | RJ | 20040-001 | Brasil

Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: [prevdata@prevdata.org.br](mailto:prevdata@prevdata.org.br)
[www.prevdata.org.br](http://www.prevdata.org.br)

## ✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



## ✓ Mediana dos Planos- Base comparativa Relatório ADITUS

## ✓ Demonstração de Resultado até JULHO/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                    | -60.923.853,16    | -85.612.947,07  | 66.298.368,74              | -19.314.578,33  |

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\$ 85.612.947,07** deduzimos o valor de **R\$ 66.298.368,74**, referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como déficit técnico remanescente a quantia de **R\$ 19.314.578,33**, sem considerar os demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 4.863.194,18**.

**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

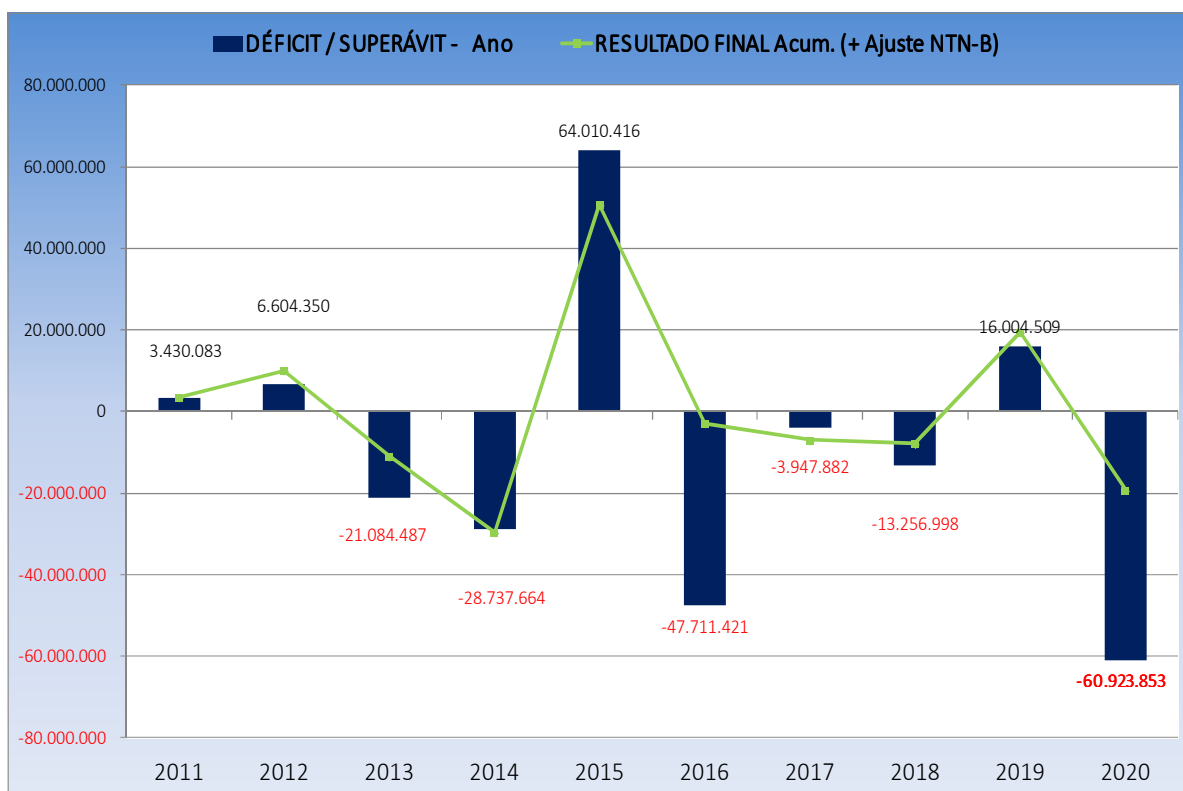
• E-mail: prevdata@prevdata.org.br

• www.prevdata.org.br





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](mailto:prevdata@prevdata.org.br)

[www.prevdata.org.br](http://www.prevdata.org.br)

## ✓ LIQUIDEZ DOS PLANOS – JULHO /20

| Liquidez dos Planos | Plano PRV      | Plano CV       | Plano PGA     |
|---------------------|----------------|----------------|---------------|
| Em D1               | 93.344.265,17  | 204.706.414,33 | 13.792.725,64 |
| Em D5               | 0,00           | 20.655.637,91  | 0,00          |
| Em 30 dias          | 103.991.478,18 | 54.953.735,34  | 6.611.376,81  |
| Em 90 dias          | 111.702.601,44 | 94.387.102,02  | 4.143.178,42  |
| Em 180 dias         | 44.110.271,41  | 62.435.337,61  | 0,00          |
| Em 1 ano            | 5.331.554,08   | 8.859.555,12   | 1.604.462,05  |
| Em 2 anos           | 24.518.331,15  | 36.706.830,93  | 5.464.164,03  |
| Em 5 anos           | 60.942.575,50  | 36.361.725,38  | 4.306.134,39  |
| Entre 6 e 10 anos   | 100.543.371,57 | 36.896.651,42  | 3.636.760,95  |
| > 10 anos           | 446.863.433,24 | 72.479.091,79  | 2.373.156,59  |

## ✓ RENTABILIDADE ACUMULADA DOS PLANOS:

| PLANO PRV           | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   | 2015    | ACUMULADO |
|---------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|-----------|
| TX. ATUARIAL        | 3,77%  | 10,23% | 9,12%  | 7,94%  | 12,76% | 17,73%  | 78,85%    |
| CONSOLIDADO         | 3,42%  | 12,72% | 10,34% | 12,39% | 14,45% | 14,73%  | 89,84%    |
| RENTA FIXA          | 4,00%  | 9,58%  | 9,65%  | 9,69%  | 14,02% | 18,36%  | 84,99%    |
| RENTA VARIÁVEL      | -5,65% | 40,91% | 28,96% | 49,39% | 26,93% | -16,04% | 172,93%   |
| IMOBILIÁRIO         | 4,46%  | 7,85%  | 30,10% | 10,87% | 8,98%  | 33,14%  | 135,77%   |
| OPER. PARTICIPANTES | 7,09%  | 11,09% | 12,66% | 10,30% | 16,93% | 19,04%  | 105,75%   |
| ESTRUTURADOS        | 3,84%  | 8,11%  | 8,05%  | 39,50% | 15,33% | -15,92% | 64,09%    |

| PLANO CV            | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   | 2015   | ACUMULADO |
|---------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|
| TX. ATUARIAL        | 3,65%  | 10,23% | 9,12%  | 7,88%  | 12,66% | 17,67% | 78,31%    |
| CONSOLIDADO         | 0,56%  | 16,33% | 10,04% | 16,19% | 18,01% | 8,01%  | 90,64%    |
| RENTA FIXA          | 1,60%  | 9,35%  | 8,38%  | 11,17% | 16,69% | 23,55% | 92,99%    |
| RENTA VARIÁVEL      | -4,54% | 41,71% | 21,58% | 35,60% | 24,87% | -8,60% | 154,51%   |
| OPER. PARTICIPANTES | 6,88%  | 11,15% | 12,50% | 10,16% | 16,74% | 18,98% | 104,49%   |
| ESTRUTURADOS        | 4,49%  | 8,23%  | 5,59%  | 32,42% | 18,52% | -8,23% | 72,00%    |

| PLANO PGA        | 2020   | 2019   | 2018  | 2017   | 2016   | 2015   | ACUMULADO |
|------------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|-----------|
| TX. ATUARIAL     | 3,42%  | 9,71%  | 8,61% | 7,68%  | 12,44% | 17,40% | 75,15%    |
| CONSOLIDADO      | 4,31%  | 8,99%  | 8,21% | 10,11% | 14,05% | 15,78% | 78,87%    |
| RENTA FIXA       | 3,56%  | 8,27%  | 8,59% | 9,92%  | 14,04% | 15,78% | 76,70%    |
| **RENTA VARIÁVEL | -1,18% | 19,37% | -     | -      | -      | -      | 17,96%    |
| * ESTRUTURADOS   | 10,12% | 11,98% | 4,55% | 18,98% | 2,10%  | -      | 56,63%    |

| ÍNDICES  | 2020    | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   | 2015    | ACUMULADO |
|----------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|-----------|
| CDI      | 1,95%   | 5,95%  | 6,42%  | 9,93%  | 14,00% | 13,24%  | 63,13%    |
| IBOVESPA | -11,00% | 31,59% | 15,04% | 26,86% | 38,94% | -13,31% | 105,88%   |
| INPC     | 0,80%   | 4,48%  | 3,43%  | 2,07%  | 6,58%  | 11,24%  | 31,82%    |
| IPCA     | 0,46%   | 4,31%  | 3,75%  | 2,95%  | 6,29%  | 10,67%  | 31,65%    |
| SELIC    | 2,01%   | 5,96%  | 6,43%  | 9,94%  | 14,02% | 13,27%  | 63,34%    |

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