

Relatório de Investimentos Julho – 2015

✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
CONSOLIDADO	-0,59	2,63	1,53	2,24	0,43	1,17	0,81	8,50
RENTA FIXA	1,51	1,42	2,03	1,45	1,13	1,36	1,30	10,65
RENTA VARIÁVEL	-8,18	7,65	-0,38	8,83	-5,74	-1,01	-4,30	-4,30
IMÓVEIS	0,38	0,37	0,39	8,25	0,53	0,38	0,40	10,93
EMPRÉSTIMOS	1,21	1,28	2,05	1,74	2,06	1,36	1,64	11,90
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,42	1,85	0,49	-17,50	-0,40	4,90	2,44	-10,02
CDI	0,93	0,82	1,04	0,95	0,98	1,07	1,18	7,17
IBRX	-5,88	9,33	-0,51	9,12	-5,47	0,76	-3,44	2,74
IBOVESPA	-6,20	9,97	-0,84	9,93	-6,17	0,61	-4,17	1,72
TX. ATUARIAL (INPC + 5,80%)	1,96	1,64	1,99	1,18	1,47	1,24	1,05	11,01
PLANO CV	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
CONSOLIDADO	0,01	2,07	0,79	1,85	0,69	0,63	0,05	6,23
RENTA FIXA	1,96	0,89	0,94	1,72	1,69	0,70	0,55	8,76
RENTA VARIÁVEL	-8,77	8,23	-0,37	7,11	-2,99	-0,00	-2,72	-0,56
EMPRESTIMOS	1,18	1,26	2,07	1,71	2,15	1,33	1,62	11,87
INVEST. ESTRUTURADOS	-0,28	1,70	0,76	-10,88	0,11	1,31	2,09	-5,71
TX. ATUARIAL (INPC + 5,75%)	1,95	1,63	1,98	1,18	1,46	1,24	1,05	10,98
PLANO PGA	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
CONSOLIDADO	1,49	1,19	1,42	1,06	1,26	1,12	1,40	9,29
RENTA FIXA	1,49	1,19	1,42	1,06	1,26	1,12	1,40	9,29
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50%)	1,93	1,61	1,96	1,16	1,44	1,22	1,03	10,83
* 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
RENTA FIXA	526.291.060,61	83,27	142.468.474,71	68,01	16.126.740,48	100,00	684.886.275,80	79,86%
RENTA VARIÁVEL	53.493.604,72	8,46	42.690.104,79	20,38	0,00	0,00	96.183.709,51	11,22%
INVESTIMENTO ESTRUTURADO	10.992.657,62	1,74	10.698.855,41	5,11	0,00	0,00	21.691.513,03	2,53%
IMÓVEIS	4.765.475,75	0,75	0,00	0,00	0,00	0,00	4.765.475,75	0,56%
EMPRÉSTIMO	36.487.021,14	5,77	13.612.739,97	6,50	0,00	0,00	50.099.761,11	5,84%
TOTAL	632.029.819,84	100,00	209.470.174,88	100,00	16.126.740,48	100,00	857.626.735,20	100,00%

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PRV:

CONSOLIDADO	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
MEDIANA PLANOS BD	1,09	1,58	1,43	1,57	0,87	1,07	0,90	8,82
PREVDATA BD	-0,59	2,63	1,53	2,24	0,43	1,17	0,81	8,50
MEDIANAS PLANOS CV	0,87	1,83	0,96	1,92	0,86	0,83	0,75	8,29
PREVDATA CV	0,01	2,07	0,79	1,85	0,69	0,63	0,05	6,23
RENTA FIXA	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
MEDIANA PLANOS BD	1,62	1,26	1,65	1,28	1,21	1,16	1,16	9,72
PREVDATA BD - RF	1,51	1,42	2,03	1,45	1,13	1,36	1,30	10,65
MEDIANAS PLANOS CV	1,61	1,13	1,28	1,24	1,23	1,06	1,18	9,06
PREVDATA CV - RF	1,96	0,89	0,94	1,72	1,69	0,70	0,55	8,76
RENTA VARIÁVEL	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
MEDIANA PLANOS BD	-6,16	6,84	-0,07	6,48	-4,16	0,32	-3,12	-0,63
PREVDATA BD - RV	-8,18	7,65	-0,38	8,83	-5,73	-1,01	-4,30	-4,30
MEDIANAS PLANOS CV	-6,01	7,45	-0,10	6,99	-4,33	0,35	-2,81	0,72
PREVDATA CV - RV	-8,77	8,23	-0,37	7,10	-2,97	-0,00	-2,72	-0,56
INVEST. ESTRUTURADOS	01/15	02/15	03/15	04/15	05/15	06/15	07/15	2015
MEDIANA PLANOS BD	-0,12	0,51	-0,13	-0,23	0,11	-0,11	0,13	0,16
PREVDATA BD - IE	-0,42	1,85	0,49	-17,50	0,40	4,90	2,44	-10,02
MEDIANAS PLANOS CV	-0,26	0,23	-0,31	-0,20	0,22	-0,15	1,19	0,71
PREVDATA CV - IE	-0,28	1,70	0,76	-10,88	0,11	1,31	2,09	-5,71

* 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)	11,01	12,38	11,63	12,57	56,77
CONSOLIDADO	8,50	7,26	6,67	12,80	40,02
RENTA FIXA	10,65	13,62	11,18	13,17	58,18
RENTA VARIÁVEL	-4,30	-10,06	-6,02	7,60	-12,96
IMÓVEIS	10,93	4,13	3,26	117,63	159,59
EMPRÉSTIMOS	11,90	15,00	14,76	15,05	69,91
INVEST. ESTRUTURADOS	-10,02	2,94	8,61	12,76	13,44
PLANO CV	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
TX. ATUARIAL (INPC + 5,75% aa)	10,98	12,07	11,63	12,57	56,30
CONSOLIDADO	6,23	8,15	6,45	13,92	39,32
RENTA FIXA	8,76	13,23	9,84	12,87	52,67
RENTA VARIÁVEL	-0,56	-8,56	-11,79	17,97	-5,38
EMPRÉSTIMOS	11,87	14,54	12,92	14,67	65,92
INVEST. ESTRUTURADOS	-5,71	2,96	4,74	3,04	4,78
PLANO PGA	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
TX. ATUARIAL (INPC + 5,50% aa)	10,83	12,07	11,63	12,57	56,08
CONSOLIDADO	9,29	12,41	9,05	12,78	51,09
RENTA FIXA	9,29	12,41	9,05	12,78	51,09
ÍNDICES	2015	2014	2013	2012	ACUMULADO
CDI	7,17	10,81	8,06	8,39	39,09
IBRX	2,74	-2,78	-3,14	11,55	7,93
IBOVESPA	1,72	-2,91	-15,51	7,38	-10,40
IPCA	6,83	6,41	5,91	5,84	27,43

✓ Demonstração de Resultado até Jul/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	39.644.994,95	-142.722,83		9.968.170,74

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

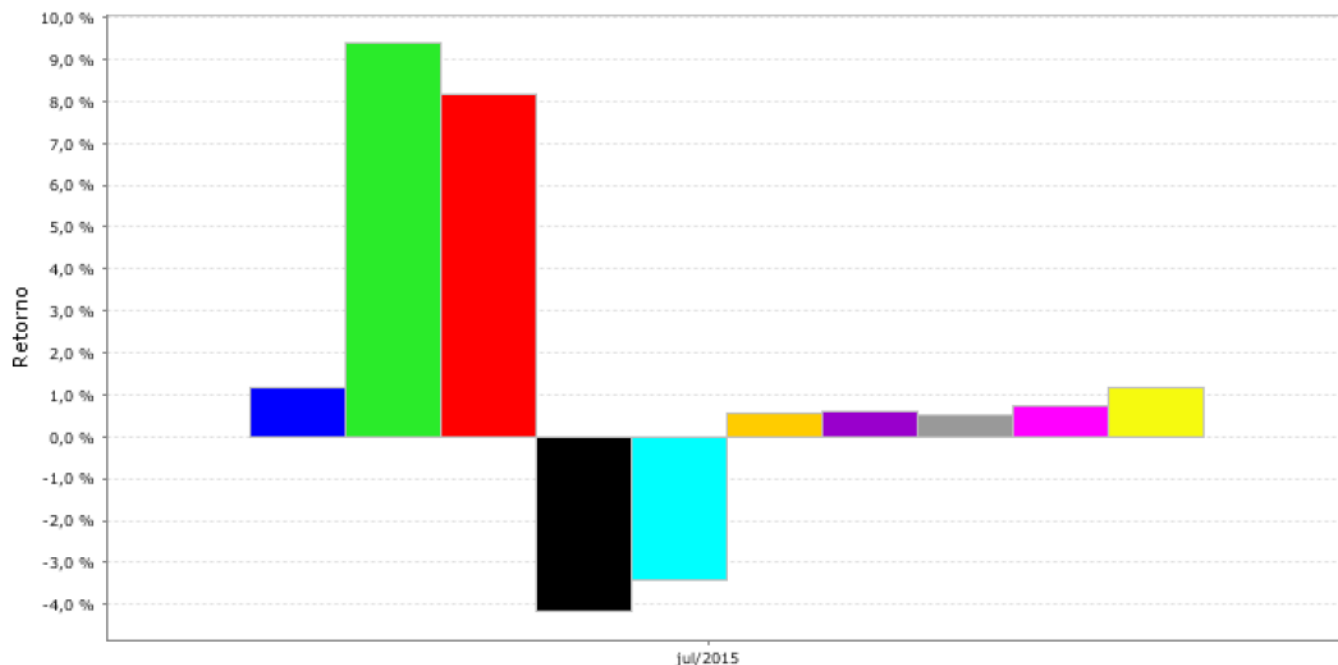
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br

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



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
CDI	1,18 %	7,17 %	1,18 %	1,18 %
Dólar	9,39 %	27,78 %	9,39 %	9,39 %
Euro	8,17 %	15,99 %	8,17 %	8,17 %
Ibovespa	-4,17 %	1,71 %	-4,17 %	-4,17 %
IBX	-3,44 %	2,74 %	-3,44 %	-3,44 %
INPC	0,58 %	7,42 %	0,58 %	0,58 %
IPCA	0,62 %	6,83 %	0,62 %	0,62 %
Ouro	0,51 %	17,85 %	0,51 %	0,51 %
Poupança	0,73 %	4,46 %	0,73 %	0,73 %
Selic	1,18 %	7,19 %	1,18 %	1,18 %

*A data usada para o cálculo foi 31/07/2015.

(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