

Relatório de Investimentos Setembro – 2020

✓ ALOCAÇÃO DOS PLANOS:

SEGMENTOS	PLANO PRV	% S/PL	PLANO CV	% S/PL	PLANO PGA	% S/PL	CONSOLIDADO	% S/PL
RENTA FIXA	706.037.996,71	71,8%	343.580.971,89	55,58%	36.010.002,85	84,69%	1.085.628.971,45	66,01%
ESTRUTURADOS	132.796.835,47	13,50%	79.319.958,54	12,83%	4.863.149,75	11,44%	216.979.943,76	13,19%
RENTA VARIÁVEL	113.776.915,88	11,56%	160.552.849,69	25,97%	1.648.746,52	3,88%	275.978.512,09	16,78%
EXTERIOR	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
IMOBILIÁRIOS	4.317.595,53	0,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	4.317.595,53	0,26%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	26.930.255,03	2,74%	34.757.116,74	5,62%	0,00	0,00%	61.687.371,77	3,75%
TOTAL	983.859.598,62	100,0%	618.210.896,86	100,0%	42.521.899,12	100,0%	1.644.592.394,60	100,0%
PL MÊS ANTERIOR	990.807.171,72		627.149.394,81		42.348.393,68		1.660.304.960,21	

Plano PRV - Renda Fixa												
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade Maio	Rentabilidade Junho	Rentabilidade Julho	Rentabilidade Agosto	Rentabilidade Setembro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
Debêntures VALE	4,62%	3,84%	-7,94%	10,18%	1,87%	0,83%	1,10%	13,62%	13,27%	47,27%	226.778,20	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%	0,49%	0,42%	3,82%	10.148.723,38	1,03%
*Fundo Crédito Pátria Mezanino	-	-	-	-	-	0,07%	0,86%	0,83%	0,28%	2,05%	1.596.231,69	0,16%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	-5,60%	-0,11%	0,67%	0,98%	1,57%	0,74%	0,44%	-0,78%	25.929.257,20	2,64%
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%	0,41%	0,25%	-0,53%	1.069.730,58	0,11%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,23%	-0,15%	0,17%	-0,01%	0,14%	0,03%	-	1,05%	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%	0,31%	0,14%	1,75%	9.447.892,15	0,96%
**Fundo Western Asset IMA B	-	-	-	-	-	-	2,04%	-2,62%	-2,18%	-2,80%	14.749.491,90	1,50%
***Fundo Icatu Vanguardia Infl Longa FI RF LP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-3,66%	-2,62%	-6,18%	14.570.698,30	1,48%
****Fundo Santander Ativo FIC RF	-	-	-	-	-	-	-	0,09%	-0,23%	-0,14%	19.169.608,56	1,95%
*****Fundo Sul América Inflatie FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,00%	-1,26%	-1,26%	15.794.702,15	1,61%
*****Fundo BNP Paribas RF FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,22%	0,04%	0,26%	15.428.552,53	1,57%
Letra Finan.	1,36%	0,54%	0,80%	0,40%	0,08%	0,48%	0,90%	0,79%	0,92%	6,44%	39.870.208,91	4,05%
Título Público - NTN-B	1,32%	0,54%	0,77%	0,39%	0,07%	0,50%	0,88%	0,78%	0,90%	6,32%	538.036.121,16	54,69%
RENTA FIXA	1,21%	0,52%	0,41%	0,33%	0,10%	0,49%	0,88%	0,65%	0,62%	5,33%	706.037.996,71	71,76%
META ATUARIAL (INPC+ 5,10% a.a.)	0,61%	0,59%	0,60%	0,18%	0,16%	0,72%	0,86%	0,78%	1,29%	5,92%		

*início em 24/06/20

**início em 23/07/20

***início em 31/07/20

****início em 17/08/20

*****início em 17/08/20

*****início em 07/08/20

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 Agosto	Rentabilidade Setembro	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%	0,49%	0,42%	3,82%	8.252.808,02	1,33%
*Fundo Crédito Pátria Mezanino	-	-	-	-	-	0,07%	0,86%	0,83%	0,28%	2,05%	1.303.317,05	0,21%
Fundo Cx - Rio Bravo Crédito Priv.	0,46%	0,26%	-4,27%	0,53%	0,59%	0,59%	0,75%	0,41%	0,25%	-0,53%	13.276.012,39	2,15%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,23%	-0,15%	0,17%	-0,01%	0,14%	0,04%	0,05%	1,11%	1.624.328,80	0,26%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	-5,60%	-0,11%	0,67%	0,98%	1,57%	0,74%	0,44%	-0,78%	32.395.295,11	5,24%
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%	0,31%	0,14%	1,75%	45.361.623,45	7,34%
**Fundo Western Asset IMA B	-	-	-	-	-	-	2,04%	-2,62%	-2,18%	-2,80%	29.939.184,63	4,84%
***Fundo Icatu Vanguardia Infl Longa FI RF LP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-3,66%	-2,62%	-6,18%	16.815.864,93	2,72%
****Fundo Santander Ativo FIC RF	-	-	-	-	-	-	-	0,09%	-0,23%	-0,14%	16.470.408,17	2,66%
*****Fundo Sul América Inflatie FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,00%	-1,26%	-1,26%	15.721.438,62	2,54%
*****Fundo BNP Paribas RF FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,12%	0,04%	0,16%	22.488.744,54	3,64%
Letra Finan.	1,28%	0,54%	0,80%	0,38%	0,07%	0,54%	0,91%	0,78%	0,94%	6,41%	15.823.505,35	2,56%
Título Público - NTN-B	0,74%	0,53%	-2,35%	0,65%	0,97%	1,20%	1,73%	0,02%	-0,02%	3,47%	124.108.440,83	20,08%
RENTA FIXA	0,58%	0,49%	-2,22%	0,16%	0,57%	0,75%	1,28%	-0,20%	-0,29%	1,10%	343.580.971,89	55,58%
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,57%	0,58%	0,17%	0,15%	0,70%	0,84%	0,76%	1,27%	5,77%		

*início em 24/06/20

**início em 23/07/20

***início em 31/07/20

****início em 17/08/20

*****início em 17/08/20

*****início em 07/08/20

PGA - Renda Fixa												
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade Maio	Rentabilidade Junho	Rentabilidade Julho	Rentabilidade Agosto	Rentabilidade Setembro	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%	0,49%	0,42%	3,82%	585.503,27	1,38%
*Fundo Crédito Pátria Mezanino	-	-	-	-	-	0,07%	0,86%	0,83%	0,28%	2,05%	90.834,15	0,21%
Fundo Cx - AZ Quest Luce	0,46%	0,25%	-5,60%	-0,11%	0,67%	0,98%	1,57%	0,74%	0,44%	-0,78%	3.220.271,61	7,57%
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%	0,41%	0,25%	-0,53%	2.779.756,03	6,54%
Fundo Cx - BNP Paribas Match DI	0,36%	0,28%	0,23%	-0,15%	0,17%	-0,01%	0,14%	0,02%	-	1,04%	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%	0,31%	0,14%	1,75%	2.891.752,27	6,80%
**Fundo Western Asset IMA B	-	-	-	-	-	-	2,04%	-2,62%	-2,18%	-2,80%	1.749.692,61	4,11%
***Fundo Icatu Vanguardia Infl Longa FI RF LP	-	-	-	-	-	-	-	0,04%	-2,62%	-2,58%	1.935.294,76	4,55%
****Fundo Santander Ativo FIC RF	-	-	-	-	-	-	-	0,09%	-0,23%	-0,14%	1.128.426,86	2,65%
*****Fundo Sul América Inflatie FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,00%	-1,26%	-1,26%	2.069.724,24	4,87%
*****Fundo BNP Paribas RF FI RF	-	-	-	-	-	-	-	0,12%	0,04%	0,16%	3.105.501,54	7,30%
Título Público - NTN-B	1,11%	0,52%	1,34%	0,55%	0,29%	0,85%	1,58%	0,13%	0,23%	6,79%	16.453.245,51	38,69%
RENTA FIXA	0,79%	0,40%	-0,27%	0,23%	0,30%	0,71%	1,35%	0,02%	-0,14%	3,42%	36.010.002,85	84,69%
META ATUARIAL (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,54%	0,55%	0,14%	0,12%	0,67%	0,81%	0,73%	1,24%	5,47%		

*início em 24/06/20

**início em 23/07/20

***início em 17/08/20

****início em 17/08/20

*****início em 17/08/20

*****início em 07/08/20

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

3

Plano PRV - Renda Variável													
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	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%	-0,30%	-6,54%	-6,69%	26.043.000,14	2,65%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	-5,73%	-35,31%	14,30%	8,49%	18,02%	6,77%	-0,87%	-0,09%	0,11%	38.057.824,36	3,87%
BRASESCO 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%	-2,24%	-5,72%	-11,81%	6.591.105,87	0,67%
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%	-6,88%	-5,43%	4,03%	13.840.375,72	1,41%
**MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	Índice Ativo	-	-	-	-	-	-0,75%	12,57%	-3,68%	-7,68%	-0,65%	29.244.609,79	2,97%
*ETF BOVA 11	Índice Passivo	-	-	-21,25%	11,33%	8,99%	8,88%	10,73%	-	-	15,20%	0,00	0,00%
RENTA VARIÁVEL		1,71%	-7,28%	-32,00%	11,47%	8,03%	11,43%	9,65%	-2,35%	-4,60%	-12,11%	113.776.915,88	11,56%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	8,27%	-3,44%	-4,80%	-18,18%		

* Início em março 2020

** Início em Junho 2020

Plano CV - Renda Variável													
Renda Variável Plano CV	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	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%	-2,24%	-5,72%	-11,96%	9.203.240,53	1,49%
BOGARI VALUE FIC AÇÕES	Ações Valor Crescimento	2,34%	-5,83%	-30,04%	10,55%	8,04%	12,07%	10,94%	-0,30%	-6,54%	-6,71%	29.717.778,57	4,81%
XP INVESTOR FI AÇÕES	Índice Ativo	3,18%	-5,88%	-38,17%	14,71%	9,82%	9,26%	8,64%	0,45%	-6,69%	-15,84%	19.360.118,39	3,13%
PÁTRIA PIPE FEEDER INST FIC FIA	Ações Livres	6,08%	-5,73%	-35,31%	14,30%	8,49%	18,02%	6,77%	-0,87%	-0,09%	0,11%	59.019.345,80	9,55%
BRASESCO 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%	-6,88%	-5,43%	4,03%	18.054.382,64	2,92%
**MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	Índice Ativo	-	-	-	-	-	-0,75%	12,57%	-3,68%	-7,68%	-0,65%	25.197.983,76	4,08%
*ETF BOVA 11	Índice Passivo	-	-	-21,25%	11,33%	8,99%	8,88%	10,73%	-	-	15,20%	0,00	0,00%
RENTA VARIÁVEL		2,27%	-6,77%	-32,50%	11,98%	8,16%	12,13%	9,22%	-1,87%	-4,30%	-10,36%	160.552.849,69	25,97%
META DE GESTÃO (Ibovespa + 2%a.a)		-1,47%	-8,28%	-29,78%	10,43%	8,75%	8,94%	8,45%	-3,28%	-4,64%	-16,96%		

* 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

Plano PGA - Renda Variável													
Renda Variável PRV Saldado	Estratégia	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	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%	-0,30%	-6,54%	-6,85%	920.965,66	2,17%
**MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	Índice Ativo	-	-	-	-	-	-	0,00%	-3,68%	-7,68%	-11,08%	727.780,86	1,71%
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%	-1,83%	-7,05%	-9,83%	1.648.746,52	3,88%
META DE GESTÃO (Ibovespa)		-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	8,27%	-3,44%	-4,80%	-18,18%	-	-

* 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 Agosto	Rentabilidade Setembro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FIP Hamilton Lane	3,27%	-3,16%	-1,11%	2,85%	-1,58%	2,15%	4,89%	6,53%	0,10%	14,38%	8.531.800,93	0,87%
FIP Kinea	-10,51%	13,56%	0,60%	-0,13%	-0,08%	-0,10%	-0,04%	-0,04%	-0,02%	1,82%	5.678.182,93	0,58%
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	0,03%	2,88%	-0,48%	-0,04%	-0,75%	0,17%	-0,12%	2,62%	3,14%	10.850.605,37	1,10%
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	-0,07%	-0,10%	-0,16%	-0,08%	-8,09%	-0,10%	-0,09%	-0,10%	-8,71%	1.515.216,00	0,15%
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	3,26%	2,81%	0,63%	0,94%	2,80%	0,72%	-1,12%	12,96%	41.692.667,85	4,24%
FMM MAUÁ Macro	1,65%	-0,83%	-1,67%	0,10%	0,94%	1,55%	-	-	-	1,71%	0,00	0,00%
FMM BAHIA MARAUÁ	-0,18%	-0,95%	-6,54%	0,03%	0,87%	1,07%	1,75%	0,44%	-0,79%	-4,45%	10.678.924,05	1,09%
FMM BAHIA MARAUÁ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,95%	-6,54%	0,03%	0,86%	1,07%	1,75%	0,44%	-0,79%	-4,46%	15.401.422,62	1,57%
FMM AZ QUEST Multi	0,75%	0,88%	-3,11%	0,63%	1,17%	0,42%	1,19%	0,41%	-0,82%	1,45%	23.404.579,29	2,38%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	0,67%	4,31%	5,24%	1,24%	1,48%	-1,01%	-0,14%	8,70%	3.369.409,11	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%	7,04%	-7,17%	2,41%	11.674.027,32	1,19%
INVESTIMENTO ESTRUTURADOS	0,57%	0,34%	-1,40%	0,78%	0,69%	0,75%	2,08%	1,39%	-1,07%	4,15%	132.796.835,47	13,50%
META ATUARIAL (INPC + 5,10% a.a.)	0,61%	0,59%	0,60%	0,18%	0,16%	0,72%	0,86%	0,78%	1,29%	5,92%		

* 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												Patrimônio	% Ativo
ATIVOS	Rentabilidade Janeiro	Rentabilidade Fevereiro	Rentabilidade Março	Rentabilidade Abril	Rentabilidade Maio	Rentabilidade Junho	Rentabilidade Julho	Rentabilidade Agosto	Rentabilidade Setembro	Rentabilidade 2020			
FIP Hamilton Lane	3,27%	-3,16%	-1,11%	2,85%	-1,58%	2,15%	4,89%	6,53%	0,10%	14,38%	2.843.933,69	0,46%	
FIP Kinea	-10,51%	13,56%	0,60%	-0,13%	-0,08%	-0,10%	-0,04%	-0,04%	-0,02%	1,82%	2.839.072,80	0,46%	
FIP PÁTRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III	-1,13%	0,03%	2,88%	-0,48%	-0,04%	-0,75%	0,17%	-0,12%	2,62%	3,14%	2.169.803,39	0,35%	
FIP Brasil Energia Renovável	0,02%	-0,07%	-0,10%	-0,16%	-0,08%	-8,09%	-0,10%	-0,09%	-0,10%	-8,71%	909.129,60	0,15%	
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	3,26%	2,81%	0,63%	0,94%	2,80%	0,72%	-1,12%	12,96%	26.126.732,24	4,23%	
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%	0,44%	-0,79%	-4,45%	9.531.433,14	1,54%	
FMM BAHIA MARAÚ ESTRUTURADO	-0,18%	-0,95%	-6,54%	0,03%	0,86%	1,07%	1,75%	0,44%	-0,79%	-4,46%	6.171.180,69	1,00%	
FMM AZ QUEST MULTI FIM	0,75%	0,88%	-3,11%	0,63%	1,17%	0,42%	1,19%	0,41%	-0,82%	1,45%	15.515.764,73	2,51%	
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	0,67%	4,31%	5,24%	1,24%	1,48%	-1,01%	-0,14%	8,70%	5.430.223,38	0,88%	
*FMM VISTA MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	3,06%	7,04%	-7,17%	2,41%	7.782.684,88	1,26%	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,54%	0,35%	-1,54%	1,07%	1,03%	0,89%	2,09%	1,25%	-1,35%	4,37%	79.319.958,54	12,83%	
META ATUARIAL E GESTÃO (INPC + 4,90% a.a.)	0,59%	0,57%	0,58%	0,17%	0,15%	0,70%	0,84%	0,76%	1,27%	5,77%		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 Agosto	Rentabilidade Setembro	Rentabilidade 2020	Patrimônio	% Ativo
FMM IBIUNA Hedge	0,18%	2,13%	3,26%	2,81%	0,63%	0,94%	2,80%	0,72%	-1,12%	12,96%	2.189.787,92	5,15%
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%	0,44%	-0,79%	-4,46%	952.645,55	2,24%
FMM AZ QUEST MULTI FIM	-	-	-	-	-	0,53%	1,19%	0,41%	-0,82%	1,31%	719.283,50	1,69%
FMM GAP MULTIPORTFOLIO	-0,78%	-2,39%	0,67%	4,31%	5,24%	1,24%	1,48%	-1,01%	-0,14%	8,70%	274.366,17	0,65%
*FMM VISTA MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	3,06%	7,04%	-7,17%	2,41%	727.066,61	1,71%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,59%	0,47%	0,63%	1,82%	1,14%	2,74%	2,34%	1,47%	-1,91%	9,60%	4.863.149,75	9,73%
META GESTÃO (INPC + 4,50% a.a.)	0,56%	0,54%	0,55%	0,14%	0,12%	0,67%	0,81%	0,73%	1,24%	5,47%	-	-

*Início 02/07/20

✓ RENTABILIDADES DOS PLANOS:

PLANO PRV	01/20	02/20	03/20	04/20	05/20	06/20	07/20	08/20	09/20	2020
CONSOLIDADO	1,19%	-0,49%	-4,00%	1,47%	1,03%	1,68%	2,19%	0,38%	-0,22%	3,12%
RENTA FIXA	1,21%	0,52%	0,41%	0,33%	0,10%	0,49%	0,88%	0,65%	0,62%	5,33%
RENTA VARIÁVEL	1,71%	-7,28%	-32,00%	11,47%	8,03%	11,43%	9,65%	-2,35%	-4,60%	-12,11%
IMOBILIÁRIO	0,56%	0,57%	0,64%	0,65%	0,67%	0,63%	0,65%	0,58%	0,66%	5,74%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,91%	0,86%	0,83%	0,85%	0,61%	0,65%	0,95%	1,05%	9,27%
ESTRUTURADOS	0,57%	0,34%	-1,40%	0,78%	0,69%	0,75%	2,08%	1,39%	-1,07%	4,15%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,30%	0,25%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	2,30%
IBOVESPA	-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	8,27%	-3,44%	-4,80%	-18,18%
META ATUARIAL (INPC + 5,10%)	0,61%	0,59%	0,60%	0,18%	0,16%	0,72%	0,86%	0,78%	1,29%	5,92%

PLANO CV	01/20	02/20	03/20	04/20	05/20	06/20	07/20	08/20	09/20	2020
CONSOLIDADO	1,10%	-1,60%	-10,79%	3,00%	2,50%	3,58%	3,63%	-0,43%	-1,42%	-1,28%
RENTA FIXA	0,58%	0,49%	-2,22%	0,16%	0,57%	0,75%	1,28%	-0,20%	-0,29%	1,10%
RENTA VARIÁVEL	2,27%	-6,77%	-32,50%	11,98%	8,16%	12,13%	9,22%	-1,87%	-4,30%	-10,36%
OPER. PARTICIPANTES	1,19%	1,88%	0,84%	0,80%	0,79%	0,59%	0,60%	0,88%	1,01%	8,92%
ESTRUTURADOS	0,54%	0,35%	-1,54%	1,07%	1,03%	0,89%	2,09%	1,25%	-1,35%	4,37%
META ATUARIAL (INPC + 4,90%)	0,59%	0,57%	0,58%	0,17%	0,15%	0,70%	0,84%	0,76%	1,27%	5,77%

PLANO PGA	01/20	02/20	03/20	04/20	05/20	06/20	07/20	08/20	09/20	2020
CONSOLIDADO	0,78%	0,38%	-1,13%	0,69%	0,66%	1,22%	1,64%	0,11%	-0,63%	3,75%
RENTA FIXA	0,79%	0,40%	-0,27%	0,23%	0,30%	0,71%	1,35%	0,02%	-0,14%	3,42%
RENTA VARIÁVEL	2,34%	-5,83%	-30,00%	11,26%	8,90%	9,17%	10,73%	-1,83%	-7,05%	-9,83%
ESTRUTURADOS	0,59%	0,47%	0,63%	1,82%	1,14%	2,74%	2,34%	1,47%	-1,91%	9,60%
META DE GESTÃO (INPC + 4,50%)	0,56%	0,54%	0,55%	0,14%	0,12%	0,67%	0,81%	0,73%	1,24%	5,47%

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

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

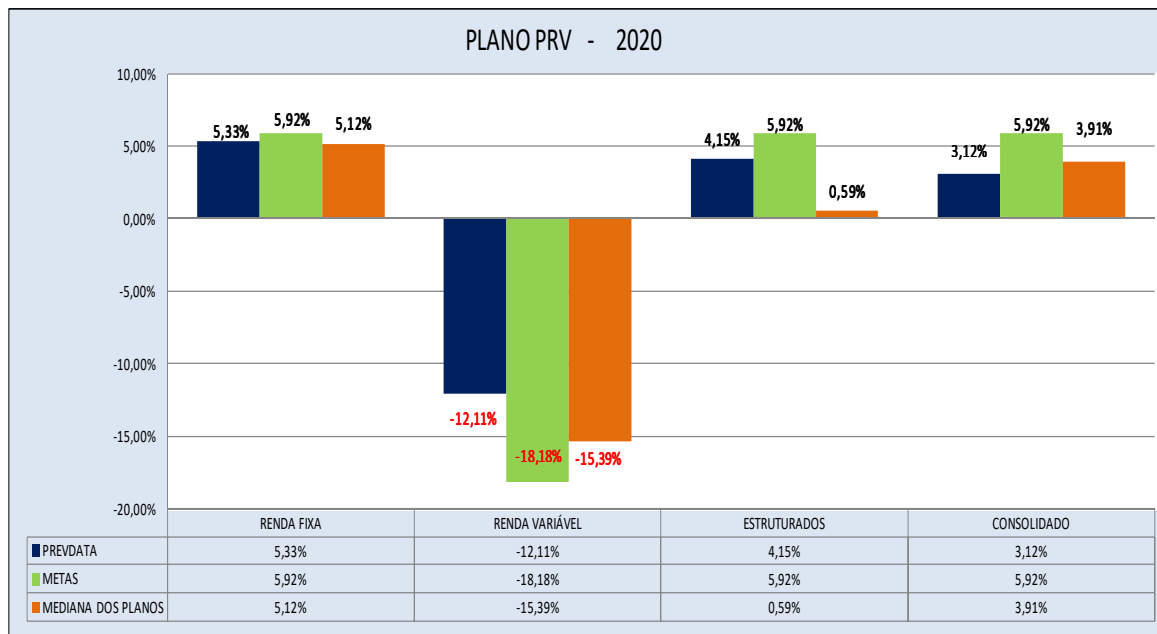
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

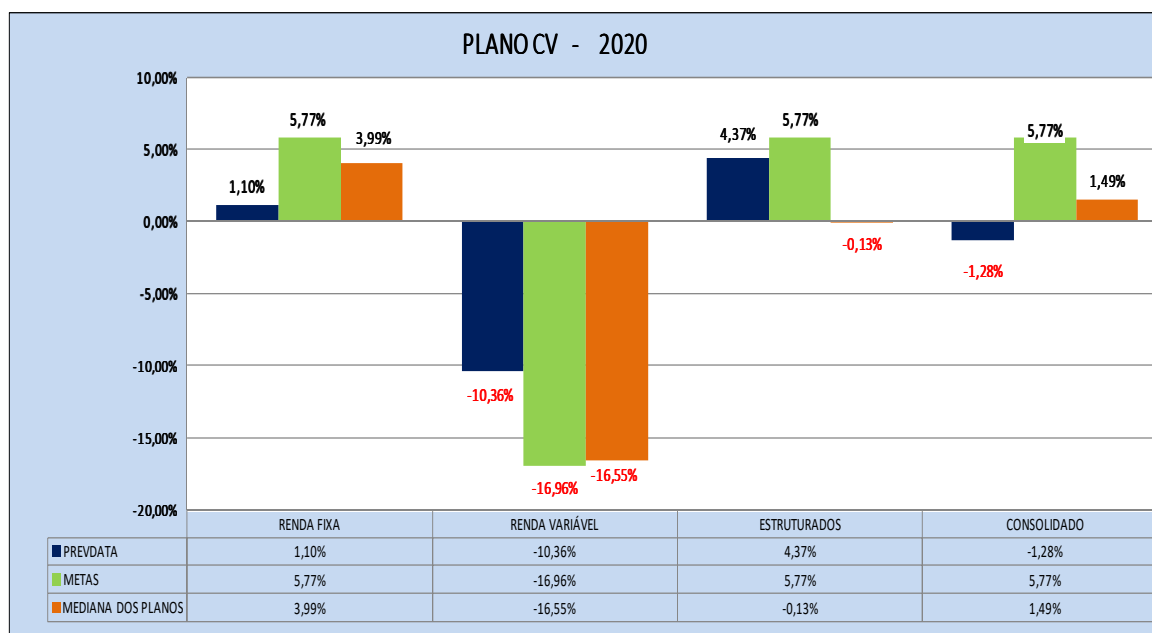
www.prevdata.org.br

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano 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

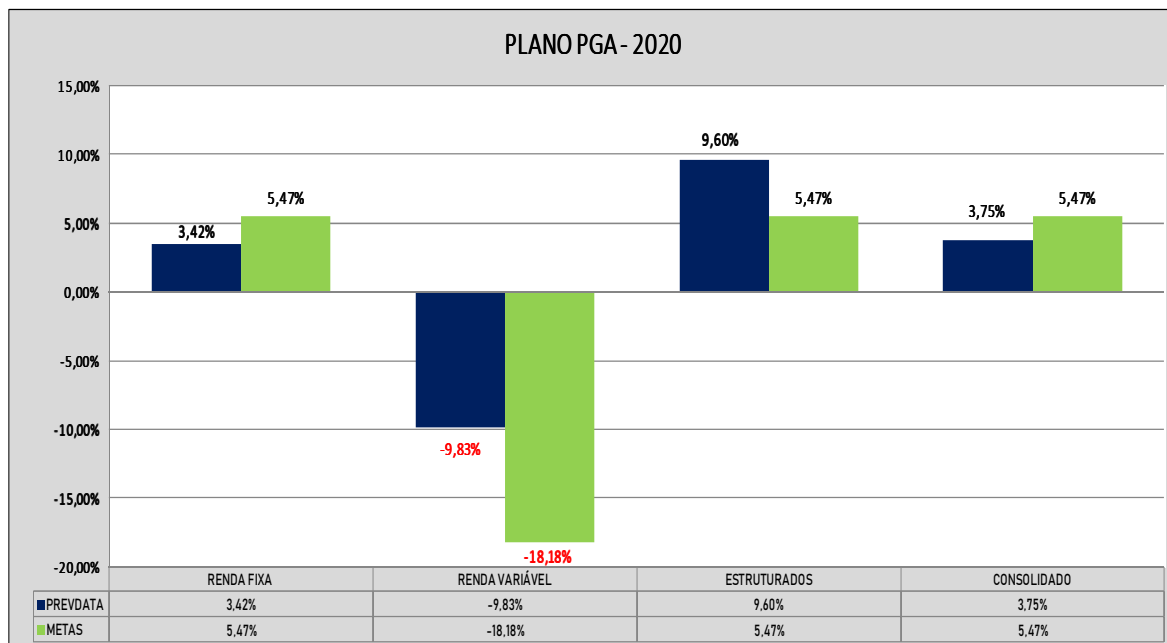
Tel.: (21) 2112-7676

Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

www.prevdata.org.br

✓ COMPARATIVO DE DESEMPENHO - Plano PGA:



✓ Mediana dos Planos- Base comparativa Relatório ADITUS

✓ Demonstração de Resultado até SETEMBRO/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	-83.222.774,41	-107.911.868,32	66.319.432,03	-41.592.436,29

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.

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

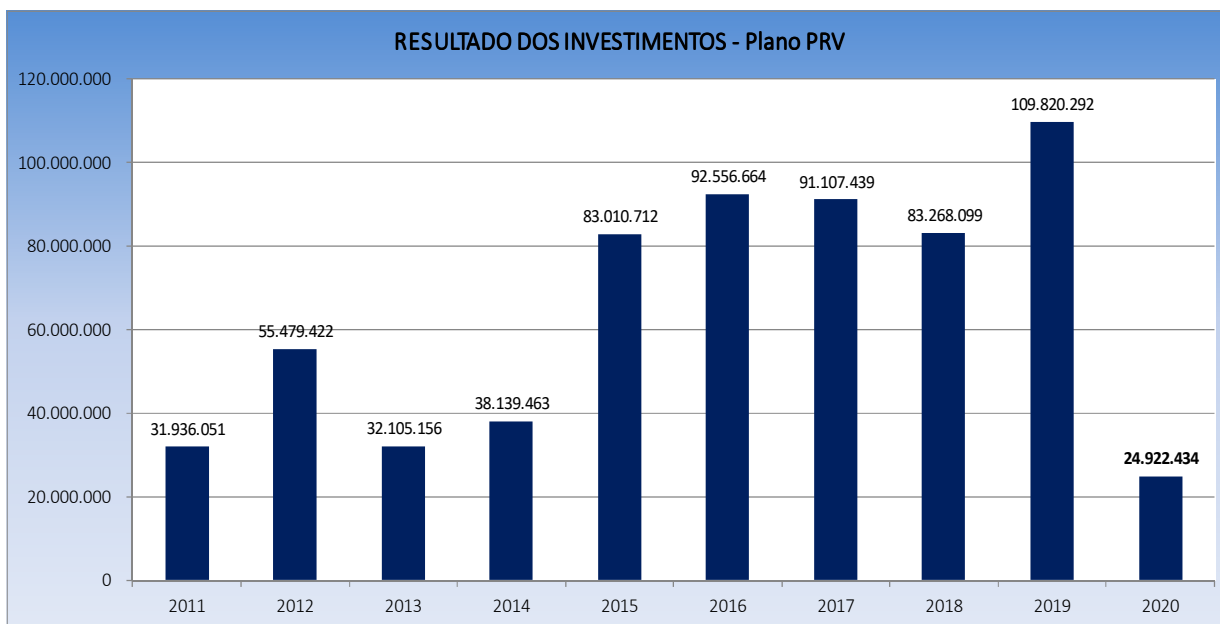
Fax: (21) 2112-7675

E-mail: prevdata@prevdata.org.br

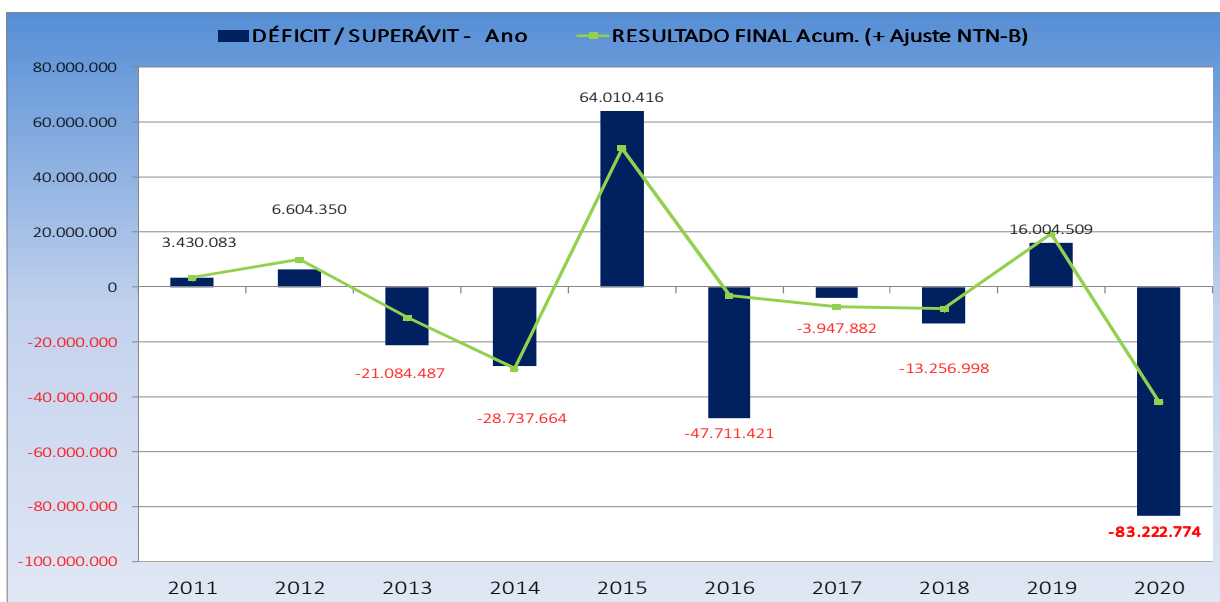
www.prevdata.org.br

Do déficit técnico atuarial de **R\$ 107.911.868,32** deduzimos o valor de **R\$ 66.319.432,03**, referente à precificação dos títulos públicos federais – NTN-B, e apuramos como déficit técnico remanescente a quantia de **R\$ 41.592.436,29**, sem considerar os demais títulos públicos federais não utilizados para o ajuste na precificação, que correspondem a **R\$ 4.883.978,06**.

9



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

www.prevdata.org.br

✓ LIQUIDEZ DOS PLANOS – SETEMBRO /20

Liquidez dos Planos	Plano PRV	Plano CV	Plano PGA
Em D1	142.933.921,77	215.038.888,75	19.874.069,59
Em D5	0,00	19.360.118,39	0,00
Em 90 dias	155.166.133,36	131.785.416,45	5.518.246,60
Em 180 dias	38.057.824,36	59.019.345,80	0,00
Em 1 ano	11.097.227,22	11.832.364,20	1.631.338,33
Em 2 anos	24.967.510,69	36.403.214,45	5.389.458,58
Em 5 anos	61.766.067,92	36.788.874,16	4.369.996,03
Entre 6 e 10 anos	100.167.759,62	36.006.853,59	3.592.673,61
> 10 anos	449.703.153,68	71.975.821,07	2.146.116,38

✓ RENTABILIDADE ACUMULADA DOS PLANOS:

PLANO PRV	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	5,92%	10,23%	9,12%	7,94%	12,76%	17,73%	82,56%
CONSOLIDADO	3,12%	12,72%	10,34%	12,39%	14,45%	14,73%	89,29%
RENTA FIXA	5,33%	9,58%	9,65%	9,69%	14,02%	18,36%	87,35%
RENTA VARIÁVEL	-12,11%	40,91%	28,96%	49,39%	26,93%	-16,04%	154,26%
IMOBILIÁRIO	5,74%	7,85%	30,10%	10,87%	8,98%	33,14%	138,66%
OPER. PARTICIPANTES	9,27%	11,09%	12,66%	10,30%	16,93%	19,04%	109,94%
ESTRUTURADOS	4,15%	8,11%	8,05%	39,50%	15,33%	-15,92%	64,58%

PLANO CV	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	5,77%	10,23%	9,12%	7,88%	12,66%	17,67%	81,96%
CONSOLIDADO	-1,28%	16,33%	10,04%	16,19%	18,01%	8,01%	87,15%
RENTA FIXA	1,10%	9,35%	8,38%	11,17%	16,69%	23,55%	92,05%
RENTA VARIÁVEL	-10,36%	41,71%	21,58%	35,60%	24,87%	-8,60%	139,01%
OPER. PARTICIPANTES	8,92%	11,15%	12,50%	10,16%	16,74%	18,98%	108,39%
ESTRUTURADOS	4,37%	8,23%	5,59%	32,42%	18,52%	-8,23%	71,80%

PLANO PGA	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
TX. ATUARIAL	5,47%	9,71%	8,61%	7,68%	12,44%	17,40%	78,62%
CONSOLIDADO	3,75%	8,99%	8,21%	10,11%	14,05%	15,78%	77,91%
RENTA FIXA	3,42%	8,27%	8,59%	9,92%	14,04%	15,78%	76,47%
**RENTA VARIÁVEL	-9,83%	19,37%	-	-	-	-	7,64%
* ESTRUTURADOS	9,60%	11,98%	4,55%	18,98%	2,10%	-	55,89%

ÍNDICES	2020	2019	2018	2017	2016	2015	ACUMULADO
CDI	2,30%	5,95%	6,42%	9,93%	14,00%	13,24%	63,69%
IBOVESPA	-18,18%	31,59%	15,04%	26,86%	38,94%	-13,31%	89,26%
INPC	2,04%	4,48%	3,43%	2,07%	6,58%	11,24%	33,45%
IPCA	1,34%	4,31%	3,75%	2,95%	6,29%	10,67%	32,81%
SELIC	2,35%	5,96%	6,43%	9,94%	14,02%	13,27%	63,88%

Obs.: *O segmento de Investimentos Estruturados no Plano PGA, teve início em Dez/2016 e Renda Variável em Ago/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