

Boletim de

DESEMPENHO

PREVI Futuro - Ago / 2018



=

Resultado



Balanço Patrimonial

Ativo

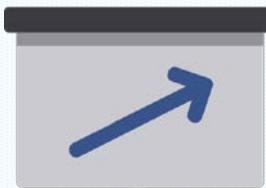
Onde estão aplicados todos os recursos do Plano PREVI Futuro



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Distribuição da Carteira de Investimentos - Ago / 2018

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas



59,02%

Renda Variável



Investimentos em ações



23,59%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples



11,92%

Investimentos Imobiliários



Comprar, vender e alugar imóveis comerciais, galpões logísticos e shopping centers

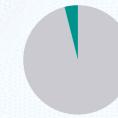


3,93%

Investimentos Estruturados



Investir em empresas com potencial de crescimento e vender a participação anos depois

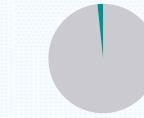


1,40%

Investimentos no Exterior



Aplicar ativos em países estrangeiros para obtenção de rentabilidade



0,14%

Passivo



Reservas matemáticas para fazer frente aos compromissos atuais e futuros dos pagamentos de benefícios

Meta:

INPC
+
5% a.a.

Balanço Patrimonial

Ativo

Onde estão aplicados todos os recursos do Plano PREVI Futuro



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Passivo



Distribuição da Carteira de Investimentos - Ago / 2018

Rentabilidade 2018: **5,02%** Valor de Mercado (mil) Ago / 2018: **13.095.116**



Rentabilidade
2018
5,44%

Valor
Ago-2018 (mil)
7.728.693



Rentabilidade
2018
0,93%

Valor
Ago-2018 (mil)
3.089.341



Rentabilidade
2018
6,38%

Valor
Ago-2018 (mil)
1.561.320



Rentabilidade
2018
5,85%

Valor
Ago-2018 (mil)
514.810



Rentabilidade
2018
24,71%

Valor
Ago-2018 (mil)
182.874



Rentabilidade
2018
23,74%

Valor
Ago-2018 (mil)
18.079

Reservas matemáticas para fazer frente aos compromissos atuais e futuros dos pagamentos de benefícios

Meta acumulada em 2018:
6,23%

● Abaixo da Meta

● Acima da Meta



Rentabilidade Acumulada

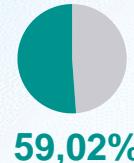
Meta Atuarial
acumulada:
6,23%

	Valor (R\$ Mil)	Participação (%)	Rentabilidade de Agosto %	Rentabilidade Acumulada em 2018
PREVI Futuro	13.095.116	100%	-0,37%	5,02%
Renda Fixa	7.728.693	59,02%	0,12%	5,44%
Renda Variável	3.089.341	23,59%	-3,09%	0,93%
Ações	3.039.047	98,37%	-3,09%	1,06%
Fundos	50.293	1,63%	-3,28%	-6,67%
Investimentos Estruturados	182.874	1,40%	3,71%	24,71%
Investimentos Exterior	18.079	0,14%	8,74%	23,74%
Investimentos Imobiliários	514.810	3,93%	0,43%	5,85%
Operações com Participantes	1.561.320	11,92%	1,83%	6,38%
Superávit/Déficit (R\$ Milhões)			-12,9	24,7
Resultado Acumulado (R\$ Milhões)				176,7



Renda Fixa

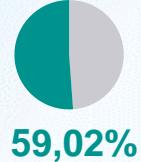
confira a relação completa dos ativos da carteira



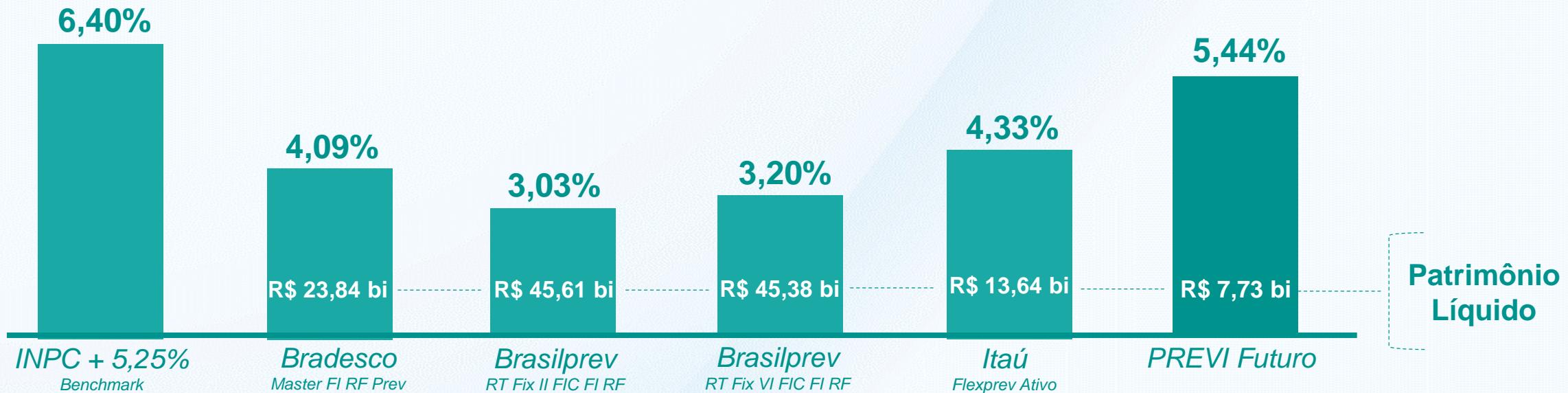
Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade Ago / 2018	Rentabilidade Acumulado 2018
Renda Fixa	7.728.693	59,02%	0,12%	5,44%
Títulos públicos mantidos até o vencimento títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional que têm seu valor nominal atualizado diariamente, pela sua taxa de juros. Ex: NTN-B	3.192.650	41,31%	0,70%	7,46%
Títulos públicos para negociação títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional precificados pelo valor de mercado em uma determinada data. Esse preço de mercado é apurado diariamente com base nas negociações de compra/venda dos diversos agentes no mercado secundário.	2.814.608	36,42%	-0,60%	2,71%
Caixa operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic.	254.658	3,29%	0,57%	4,33%
Títulos privados de instituições financeiras títulos de renda fixa emitidos pelos bancos, como CDB e Letras Financeiras, que possuem prazo de vencimento superior a 2 anos.	660.742	8,55%	0,70%	6,45%
Títulos privados de instit. não financeiras títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias.	722.915	9,35%	-0,72%	5,13%
Fundos de Investimentos RF	83.118	1,08%	0,59%	6,58%



Eficiência Renda Fixa



Rentabilidade do PREVI Futuro x Mercado – Janeiro a Agosto de 2018

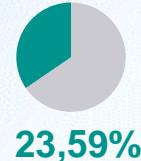


Fonte: site CVM.



Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

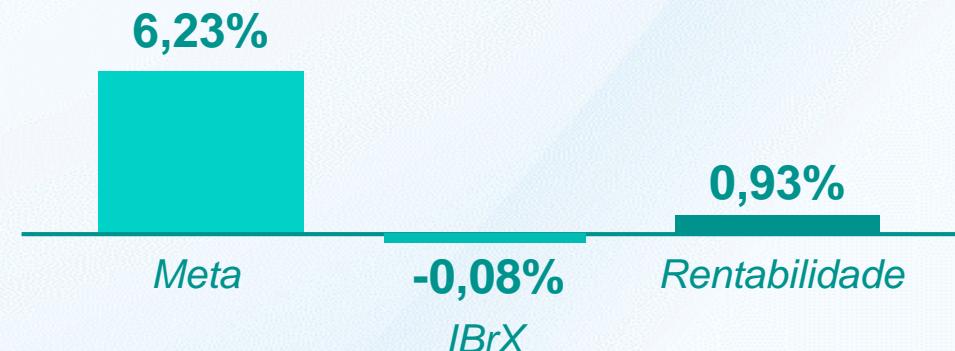


23,59%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade Ago / 2018	Rentabilidade Acum. 2018
Renda Variável	3.089.341	23,59%	-3,09%	0,93%
Ações	3.039.047	98,37%	-3,09%	1,06%
Fundos	50.293	1,63%	-3,28%	-6,67%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade

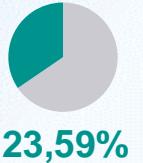




Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

Valor Financeiro
(R\$ milhões)



12 Maiores Ativos	Ago / 2018	% na carteira	% patrimônio total
VALE R DOCE ON N1	373,13	12,08%	2,85%
ITAUUNIBANCO PN N1	303,54	9,83%	2,32%
BRADESCO PN EG N1	201,64	6,53%	1,54%
PETROBRAS PN	174,70	5,65%	1,33%
AMBEV S/A ON	164,53	5,33%	1,26%
PETROBRAS ON	131,69	4,26%	1,01%
B3 ON NM	97,36	3,15%	0,74%
ITAUSA PN N1	94,27	3,05%	0,72%
BRASIL ON EG	81,23	2,63%	0,62%
LOJAS RENNER ON NM	54,43	1,76%	0,42%
SUZANO PAPEL ON I10 N1	52,83	1,71%	0,40%
ULTRAPAR ON N1	47,71	1,54%	0,36%

Valor total da carteira
(R\$ milhões)
3.089,34

Valor dos 12 maiores ativos
(representa 57% da carteira)
1.777,06



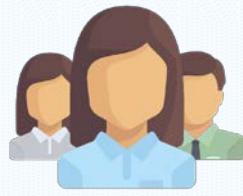
Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

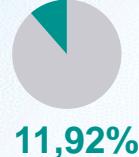
Resultado Financeiro (R\$ milhões)

OBS: O resultado financeiro considera a valorização/desvalorização do ativo apurado no período e o direito ao recebimento de dividendos e JCP eventualmente ocorridos.

Variação principais ativos	2016	2017	Acumulado 2018
VALE R DOCE ON N1	75,65	-78,70	108,59
ITAUUNIBANCO PN N1	85,79	453,43	21,46
BRADESCO PN EG N1	0,00	-234,22	-15,01
PETROBRAS PN	77,51	-18,04	32,62
AMBEV S/A ON	-5,10	258,51	-19,54
PETROBRAS ON	52,89	-14,26	32,89
B3 ON NM	22,97	165,70	-2,95
ITAUSA PN N1	33,40	20,95	5,18
BRASIL ON EG	21,75	134,21	-2,01
LOJAS RENNER ON NM	9,97	23,82	-12,85
ULTRAPAR ON N1	11,72	111,32	-38,40
SUZANO PAPEL ON I10 N1	-	-	29,85
Variação Anual (R\$ milhões)	↑ 377,94	↑ 758,73	↑ 139,82



Operações com Participantes

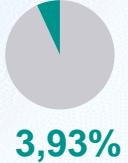


Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade Ago / 2018	Rentabilidade Acum. 2018
Empréstimos e Financiamentos	1.561.320	11,92%	1,83%	6,38%
Empréstimos Simples	1.353.575	86,69%	1,83%	6,43%
Financiamentos	207.745	13,31%	1,81%	6,06%



Investimentos Imobiliários

confira a relação completa dos ativos da carteira



Valor de Mercado (R\$ Mil)

Rentabilidade

Ago / 2018

Acumulado 2018

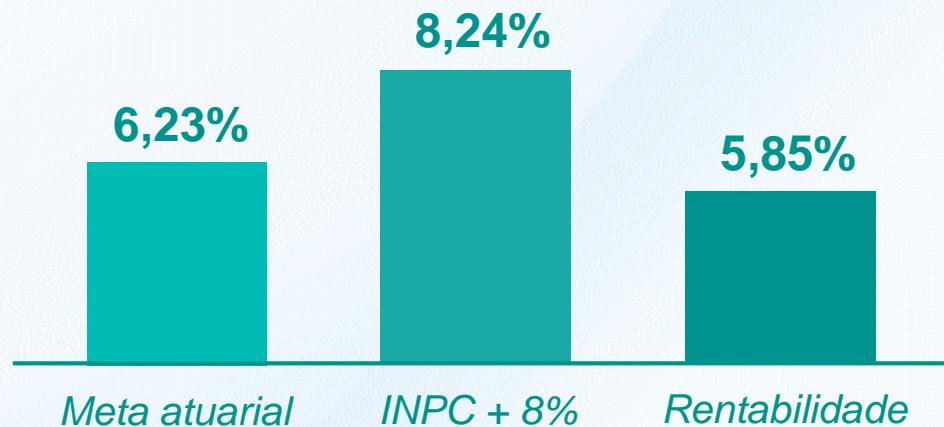
514.810

0,43%

5,85%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos Estruturados

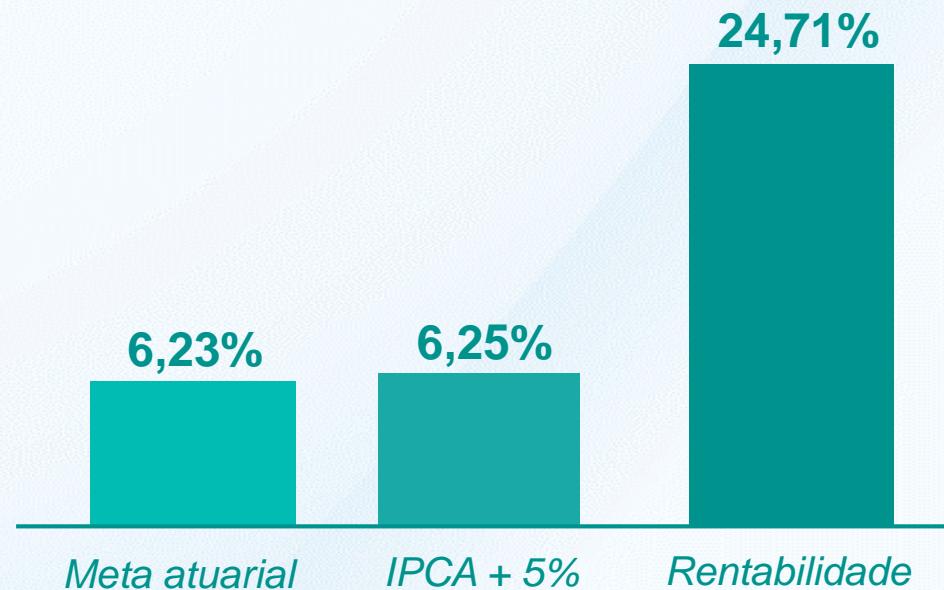
confira a relação completa dos ativos da carteira

1,40%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Ago / 2018	Acumulado 2018
182.874	3,71%	24,71%

Eficiência Comparada

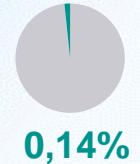
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

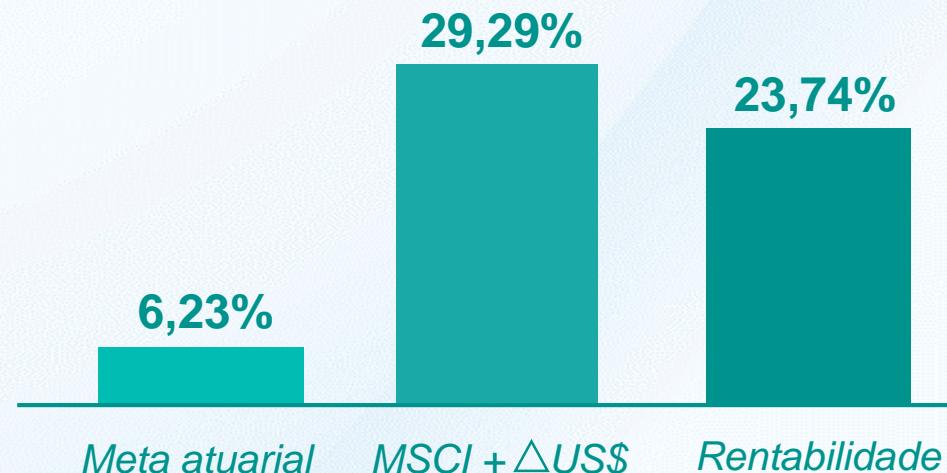
confira a relação completa dos ativos da carteira



Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Ago / 2018	Acumulado 2018
18.079	8,74%	23,74%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade



Perfil do Investidor

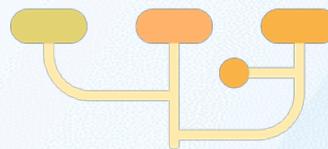
Quer saber qual é o seu? Acesse o autoatendimento do site da PREVI >> Perfis de Investimento e preencha o questionário de Análise do Perfil do Investidor (API)

Conservador



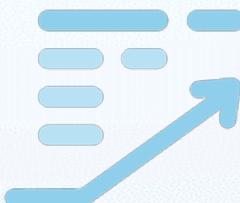
A segurança é fundamental para suas aplicações. O ideal é manter percentual representativo de sua reserva previdenciária em classes de investimentos de baixo risco, visando evitar grandes flutuações no valor dessa reserva. Perfil poder ser adequado para participantes próximos da aposentadoria.

Arrojado



Busca possibilidade de maiores ganhos no médio e longo prazo, mesmo que para isso sua reserva previdenciária seja investida em ativos mais arriscados. Pode ser adequado para os participantes que possuem valor relevante de reserva acumulado, mas cujo prazo para a aposentadoria ainda é longo.

Moderado



A segurança nos investimentos é importante, mas parte de sua reserva pode ser investida em ativos com maior risco que podem proporcionar maiores ganhos no médio e longo prazo. Diversificar é a estratégia indicada para os investimentos de participantes com esse perfil, que pode ser adequado para quem possui elevado valor acumulado, mas ainda não pensam em se aposentar.

Agressivo



Busca possibilidade de ganhos máximos, assumindo correr mais risco e não se preocupa com flutuações momentâneas no valor de suas reservas previdenciárias, pois espera compensações no longo prazo. Pode ser adequado para aqueles participantes em um período mais inicial da carreira, cujo prazo para a aposentadoria ainda é longo.

Perfis de Investimento

Quer saber mais sobre o tema e alterar o seu Perfil? Clique aqui

Conservador
0% em RV



Rentabilidade

Agosto de 2018

0,39%

Acumulado 2018

5,51%

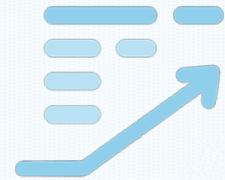
Últimos 12 meses

8,14%

Últimos 24 meses

20,33%

Moderado
0% a 20% em RV



Rentabilidade

Agosto de 2018

-0,04%

Acumulado 2018

5,19%

Últimos 12 meses

8,83%

Últimos 24 meses

23,31%

Arrojado
20% a 40% em RV



Rentabilidade

Agosto de 2018

-0,62%

Acumulado 2018

4,54%

Últimos 12 meses

9,04%

Últimos 24 meses

25,50%

Agressivo
40% a 60% em RV



Rentabilidade

Agosto de 2018

-1,00%

Acumulado 2018

4,25%

Últimos 12 meses

9,52%

Últimos 24 meses

27,51%

Meta
INPC + 5% a.a.

Agosto de 2018

0,41%

Acumulado 2018

6,23%

Últimos 12 meses

8,82%

Últimos 24 meses

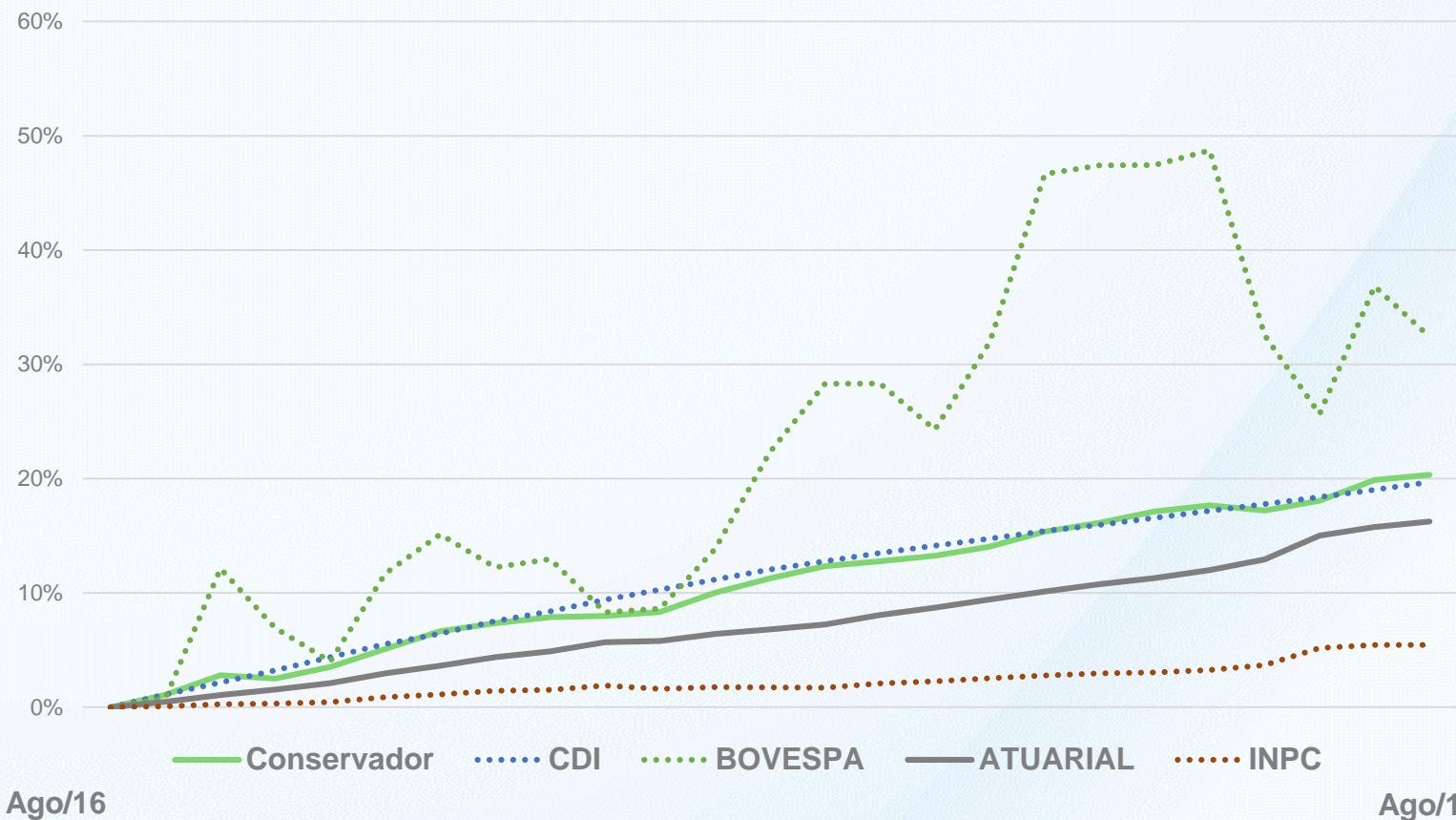
16,24%



Perfil Conservador

0% em RV

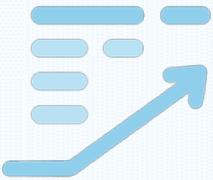
Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Agosto de 2018
0,39%
Acumulado 2018
5,51%
Últimos 12 meses
8,14%
Últimos 24 meses
20,33%

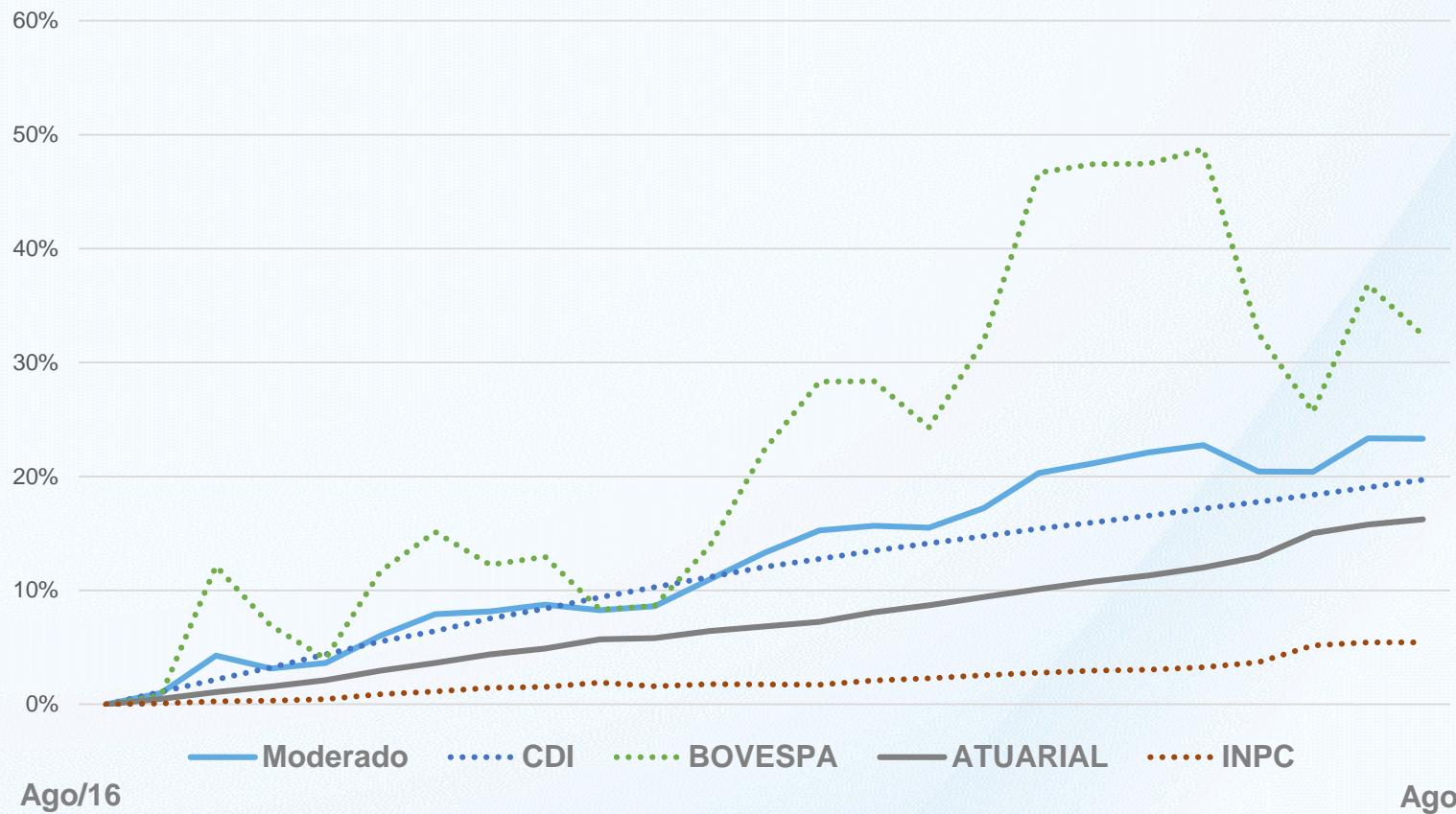
Perfil de
12,57%
dos associados



Perfil Moderado

0% a 20% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Agosto de 2018

-0,04%

Acumulado 2018

5,19%

Últimos 12 meses

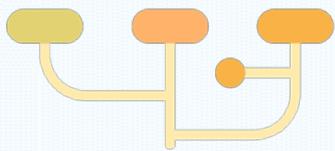
8,83%

Últimos 24 meses

23,31%



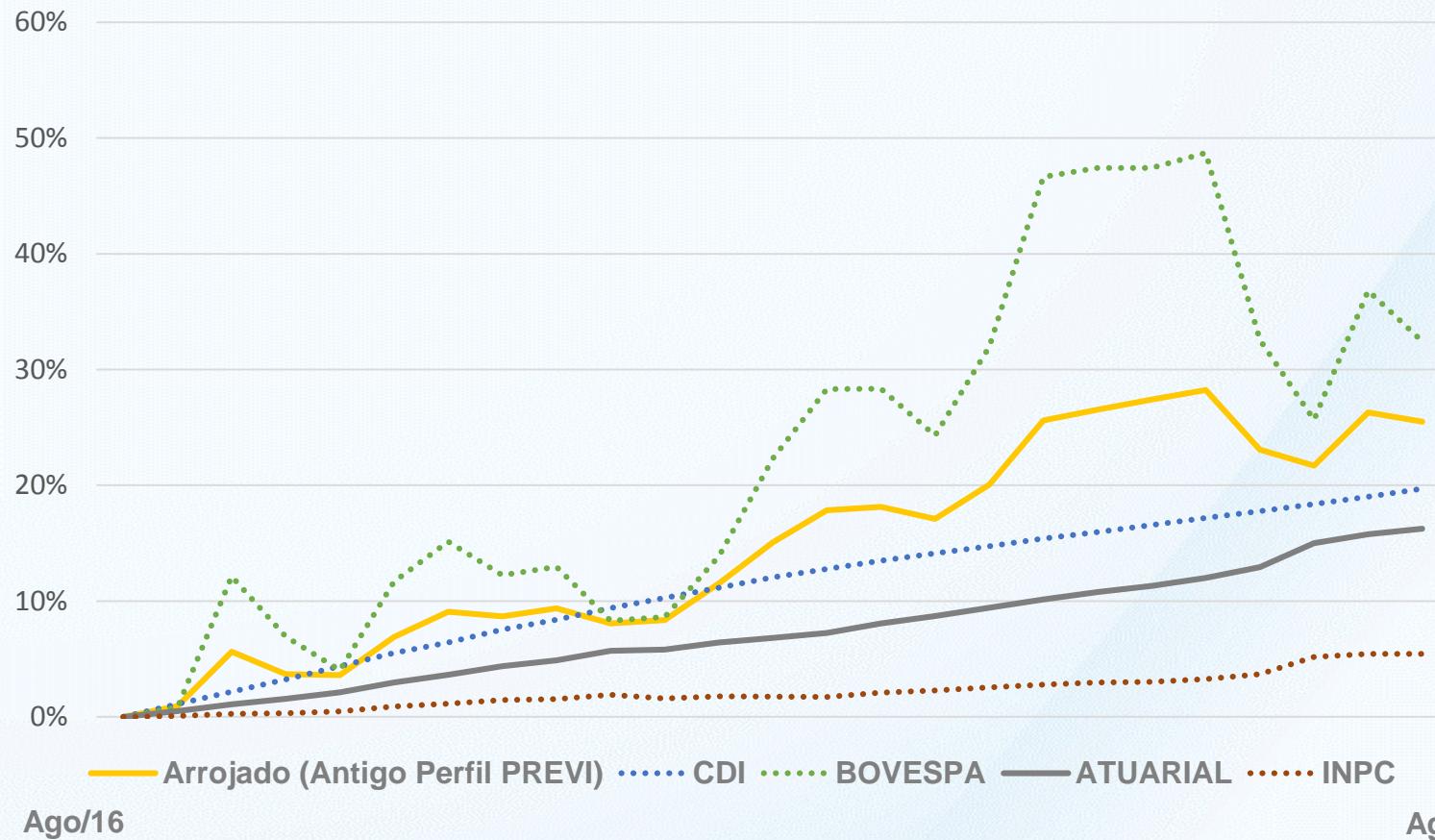
Perfil de 5,61% dos associados



Perfil Arrojado

20% a 40% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Agosto de 2018

-0,62%

Acumulado 2018

4,54%

Últimos 12 meses

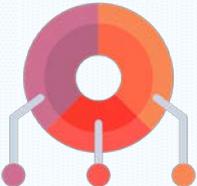
9,04%

Últimos 24 meses

25,50%



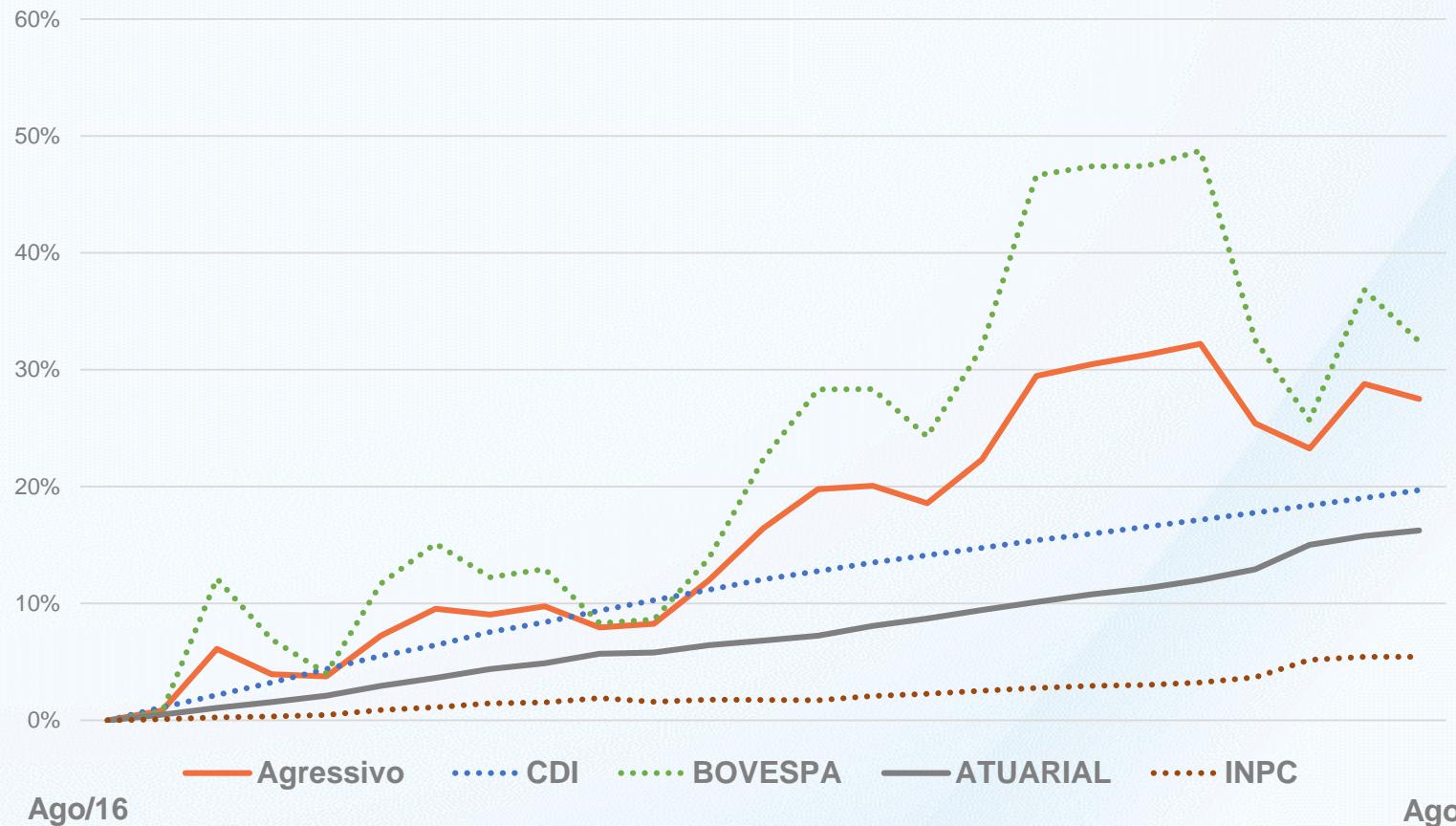
Perfil de
78,26%
dos associados



Perfil Agressivo

40% a 60% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Agosto de 2018

-1,00%

Acumulado 2018

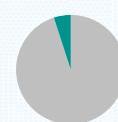
4,25%

Últimos 12 meses

9,52%

Últimos 24 meses

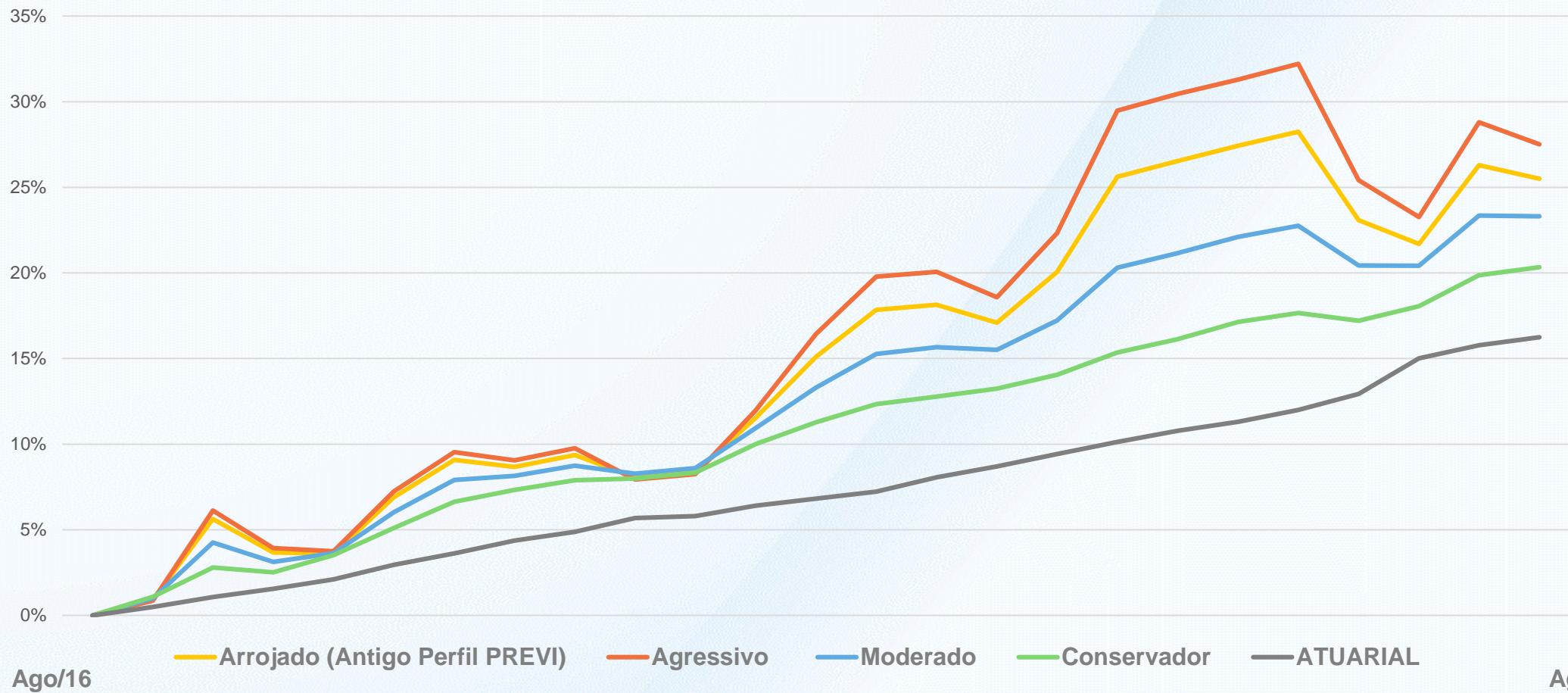
27,51%



Perfil de
3,55%
dos associados

Perfis de Investimentos

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses – Comparação entre os Perfis





[Fale Conosco](#)



0800 729 0505



[Canal Web](#)

OUVIR 0800 729 0303
SUA VOZ.