

PREVI Futuro

Conheça o desempenho de Janeiro a Agosto/2017



Balço Patrimonial

Ativo – Onde estão aplicados todos os recursos do PREVI Futuro



Passivo



Distribuição da Carteira de Investimentos

Renda Variável



Investimentos em ações



29,76%

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas



52,89%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples



11,33%

Investimentos Imobiliários



Comprar, vender e alugar imóveis comerciais e shopping centers



4,68%

Investimentos Estruturados



Turbinar empresas com potencial de crescimento e vender a participação anos depois.



1,22%

Investimentos no Exterior



Aplicar ativos em países estrangeiros para obtenção de rentabilidade



0,12%

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

INPC
5%⁺ a.a.
(meta)

Histórico e Resultado Agosto de 2017

Balanço Patrimonial

Ativo – Onde estão aplicados todos os recursos do PREVI Futuro



Passivo



Distribuição da Carteira de Investimentos

Rentabilidade 2017: 10,58% **Meta: 4,61%** **Valor de Mercado (mil) Ago-2017: 10.940.990** ●

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

Meta Acumulada em 2017: 4,61%

Renda Variável



Rentabilidade 2017

17,78%

Valor

Ago-2017 (mil)

3.256.073



Renda Fixa



Rentabilidade 2017

7,98%

Valor

Ago-2017 (mil)

5.786.264



Operações com Participantes



Rentabilidade 2017

4,96%

Valor

Ago-2017 (mil)

1.240.104



Investimentos Imobiliários



Rentabilidade 2017

0,61%

Valor

Ago-2017 (mil)

512.254



Investimentos Estruturados



Rentabilidade 2017

41,59%

Valor

Ago-2017 (mil)

133.324



Investimentos no Exterior



Rentabilidade 2017

9,90%

Valor

Ago-2017 (mil)

12.971



Histórico e Resultado Agosto de 2017

● abaixo da meta

● acima da meta



Renda Variável

Resultado Financeiro* (R\$ milhões)

[Confira a relação completa da carteira de RV do PREVI Futuro](#)

*OBS: O resultado financeiro de valorização/desvalorização do ativo apurado no período considera o recebimento de dividendos e JCP eventualmente ocorridos e está líquido de impactos de vendas/compras.

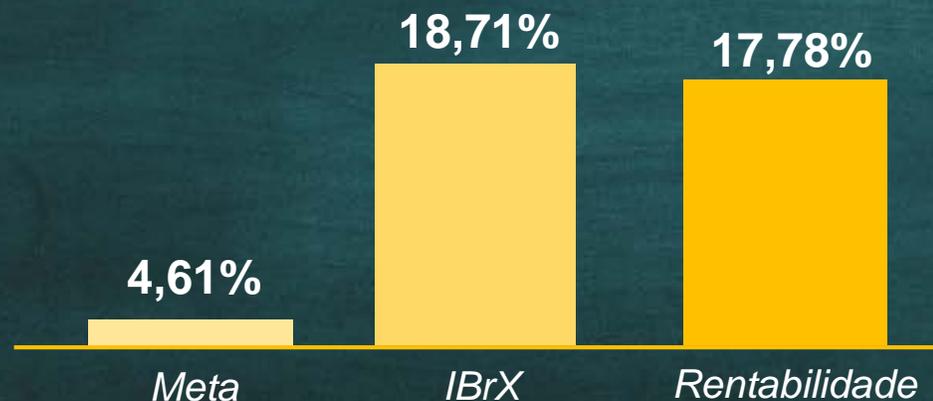


29,76%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade	
			Ago-17	Acumulado 2017
Renda Variável	3.256.073	29,76%	7,36%	17,78%
Ações	3.205.972	98,46%	7,35%	17,53%
Fundos	50.100	1,54%	8,22%	36,56%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Renda Fixa

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)



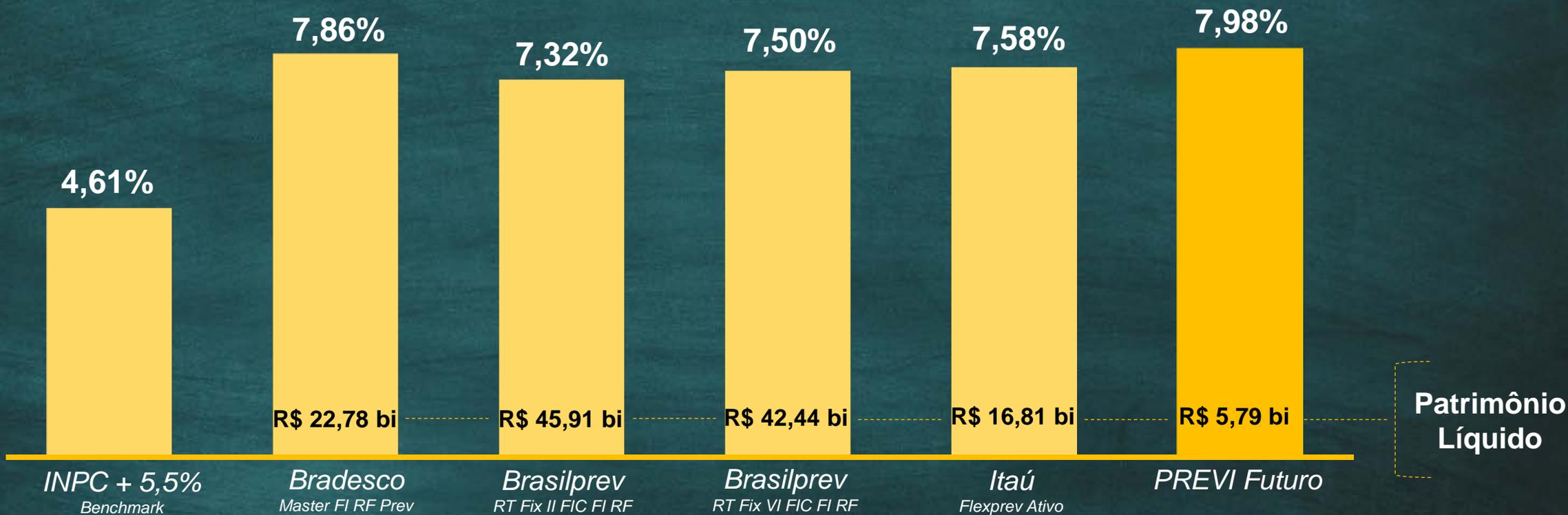
52,89%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade	
			Ago-17	Acumulado 2017
Renda Fixa	5.786.264	52,89%	1,04%	7,98%
Títulos públicos mantidos até o vencimento <small>títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional que têm seu valor nominal atualizado diariamente, pela sua taxa de juros. Ex: NTN-B</small>	2.410.392	41,66%	0,94%	5,92%
Títulos públicos para negociação <small>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.</small>	1.459.395	25,22%	1,39%	11,28%
Caixa <small>operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic.</small>	480.229	8,30%	0,80%	7,37%
Títulos privados de instituições financeiras <small>títulos de renda fixa emitidos pelos bancos, como CDB e Letras Financeiras, que possuem prazo de vencimento superior a 2 anos</small>	730.862	12,63%	0,94%	6,81%
Títulos privados de instit. não financeiras <small>títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias</small>	680.891	11,77%	0,82%	9,59%
Fundos de Investimentos RF	24.496	0,42%	1,46%	6,08%



Eficiência da Renda Fixa

Rentabilidade do PREVI Futuro x Mercado – Janeiro até Agosto de 2017



A fonte da rentabilidade dos fundos do mercado é o site Valor Econômico. A fonte do patrimônio líquido é do site da CVM.



Operações com Participantes



11,33%

Carteira	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Ago-17	Acumulado 2017
Empréstimos e Financiamentos	1.240.104	11,33%	0,38%	4,96%
Empréstimos Simples	1.127.702	90,94%	0,41%	5,00%
Financiamentos	112.402	9,06%	0,11%	4,53%



Investimentos Imobiliários

[confira a relação completa dos imóveis do PREVI Futuro](#)



4,68%

Valor de Mercado (R\$ Mil)

512.254

Rentabilidade

Ago-17

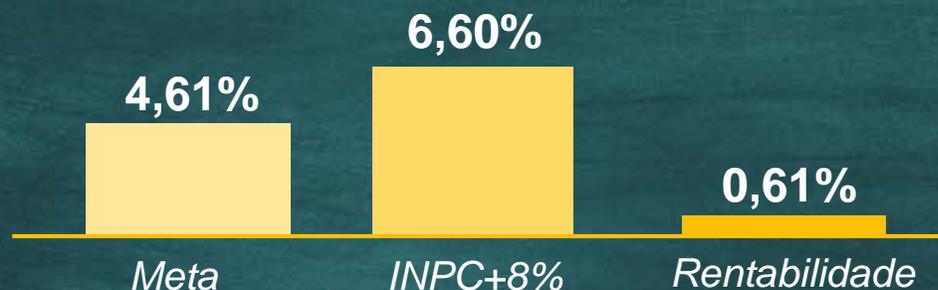
Acumulado 2017

-0,36%

0,61%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade



Ao longo de 2017 foram realizadas diversas reavaliações patrimoniais e algumas delas sofreram impactos negativos do momento atual de mercado, decorrentes de taxas de vacância e sobre oferta de espaços para locação. Como o setor é cíclico, importante analisar a rentabilidade no longo prazo, para neutralizar esses impactos pontuais. No caso do Previ Futuro, a rentabilidade no longo prazo ainda está comprometida pela presença de imóveis ainda em fase de construção, situação essa que será revertida quando do início da geração de receitas desses ativos.



Investimentos Estruturados

[confira a relação completa dos investimentos estruturados do PREVI Futuro](#)

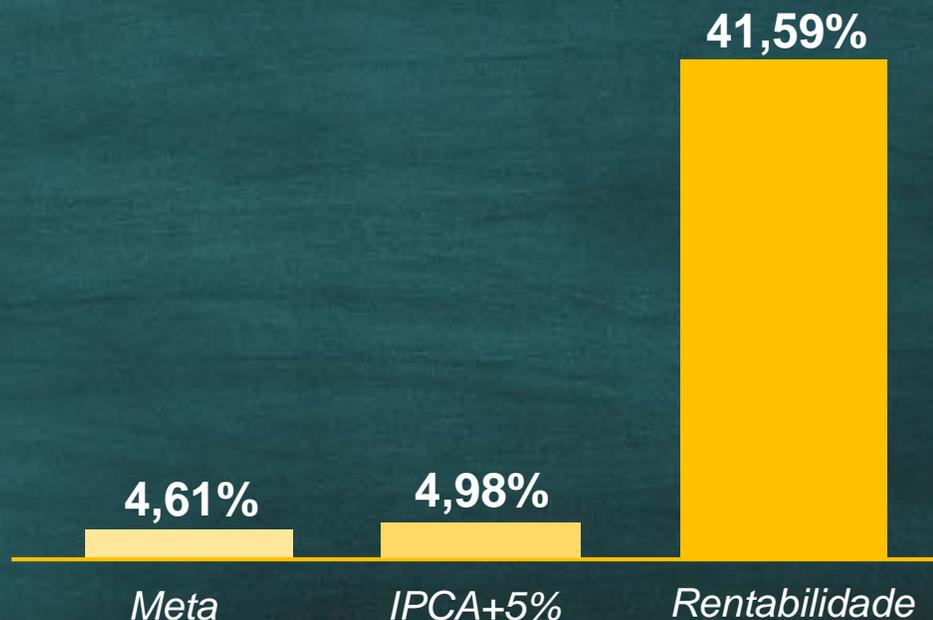


1,22%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Ago-17	Acumulado 2017
133.324	3,87%	41,59%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

[confira a relação completa dos investimentos no exterior do PREVI Futuro](#)

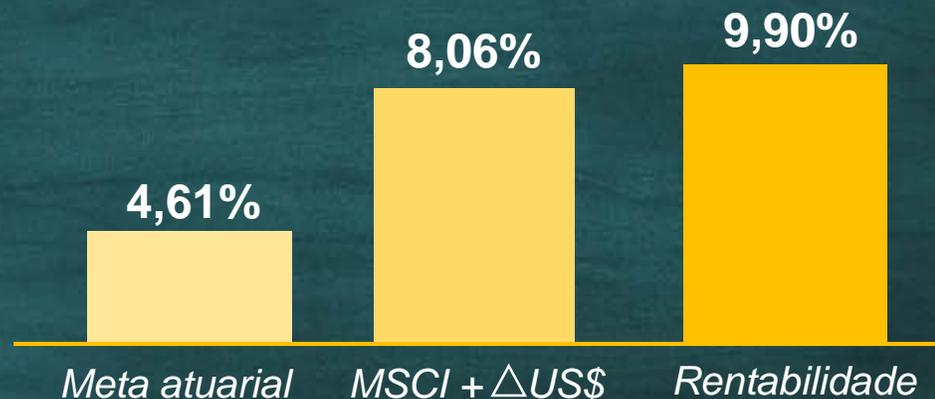


0,12%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Ago-17	Acumulado 2017
12.971	0,51%	9,90%

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

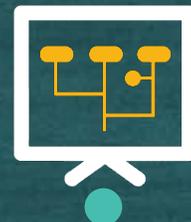


Busca possibilidade de ganhos máximos, assumindo correr mais risco e não se preocupa com flutuações momentâneas no valor de suas reservas previdenciárias, pois espera compensações no longo prazo. Pode ser adequado para aqueles participantes em um período mais inicial da carreira, cujo prazo para a aposentadoria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



Perfis de Investimento

[Quer saber mais sobre o tema e alterar o seu Perfil? Clique aqui](#)

Conservador 0% em RV 	Moderado 0% a 20% em RV 	Arrojado 20% a 40% em RV 	Agressivo 40% a 60% em RV 	Meta INPC + 5% a.a.
Rentabilidade	Rentabilidade	Rentabilidade	Rentabilidade	
Agosto de 2017 1,15% Acumulado 2017 7,48% Últimos 12 meses 11,27% Últimos 24 meses 30,92%	Agosto de 2017 2,13% Acumulado 2017 9,33% Últimos 12 meses 13,30% Últimos 24 meses 33,38%	Agosto de 2017 3,20% Acumulado 2017 11,09% Últimos 12 meses 15,10% Últimos 24 meses 35,51%	Agosto de 2017 3,98% Acumulado 2017 12,22% Últimos 12 meses 16,43% Últimos 24 meses 37,90%	Agosto de 2017 0,38% Acumulado 2017 4,61% Últimos 12 meses 6,82% Últimos 24 meses 22,95%

 abaixo da meta

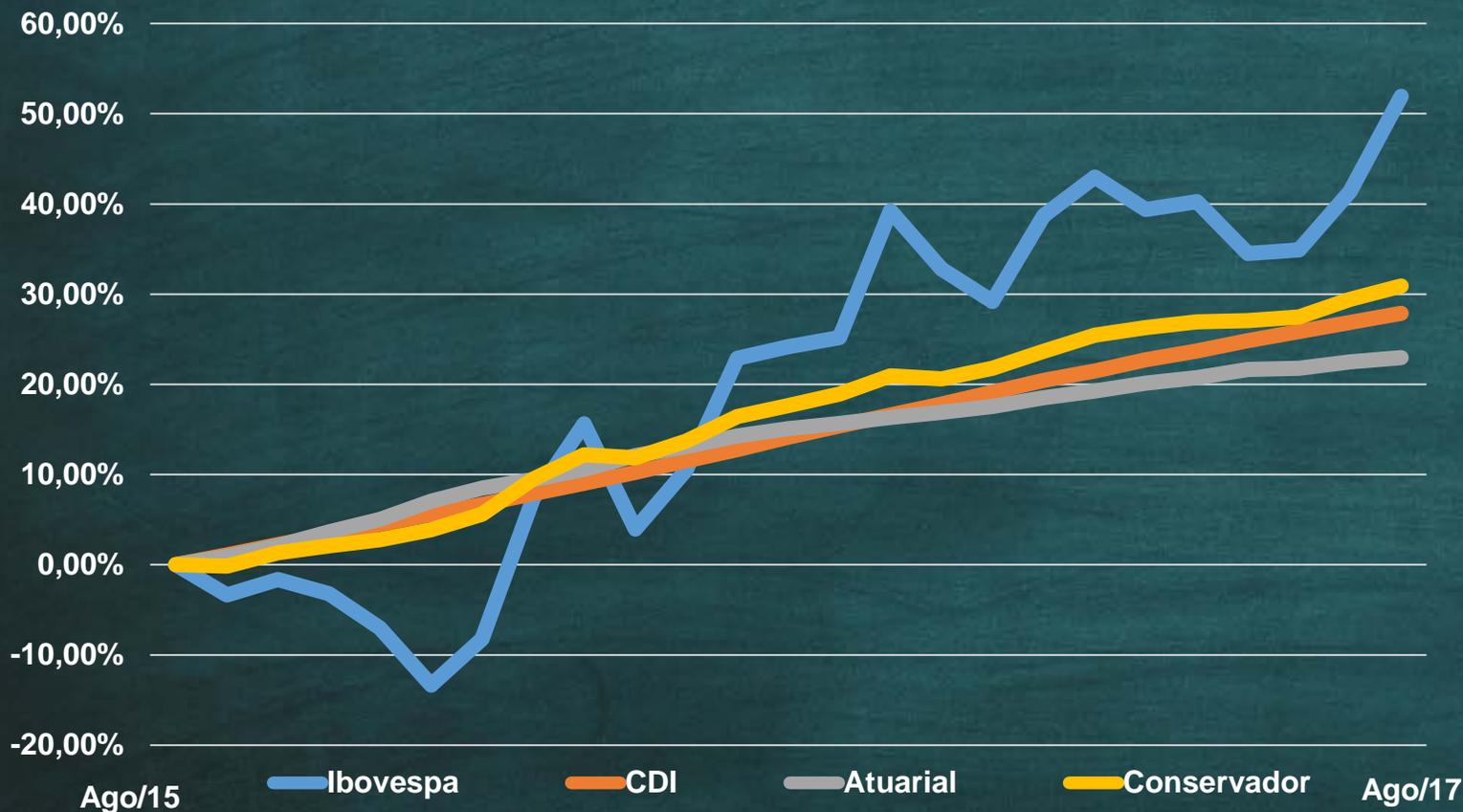
 acima da meta



Perfil Conservador

0% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Agosto de 2017

1,15%

Acumulado 2017

7,48%

Últimos 12 meses

11,27%

Últimos 24 meses

30,92%



Perfil de

15,86%

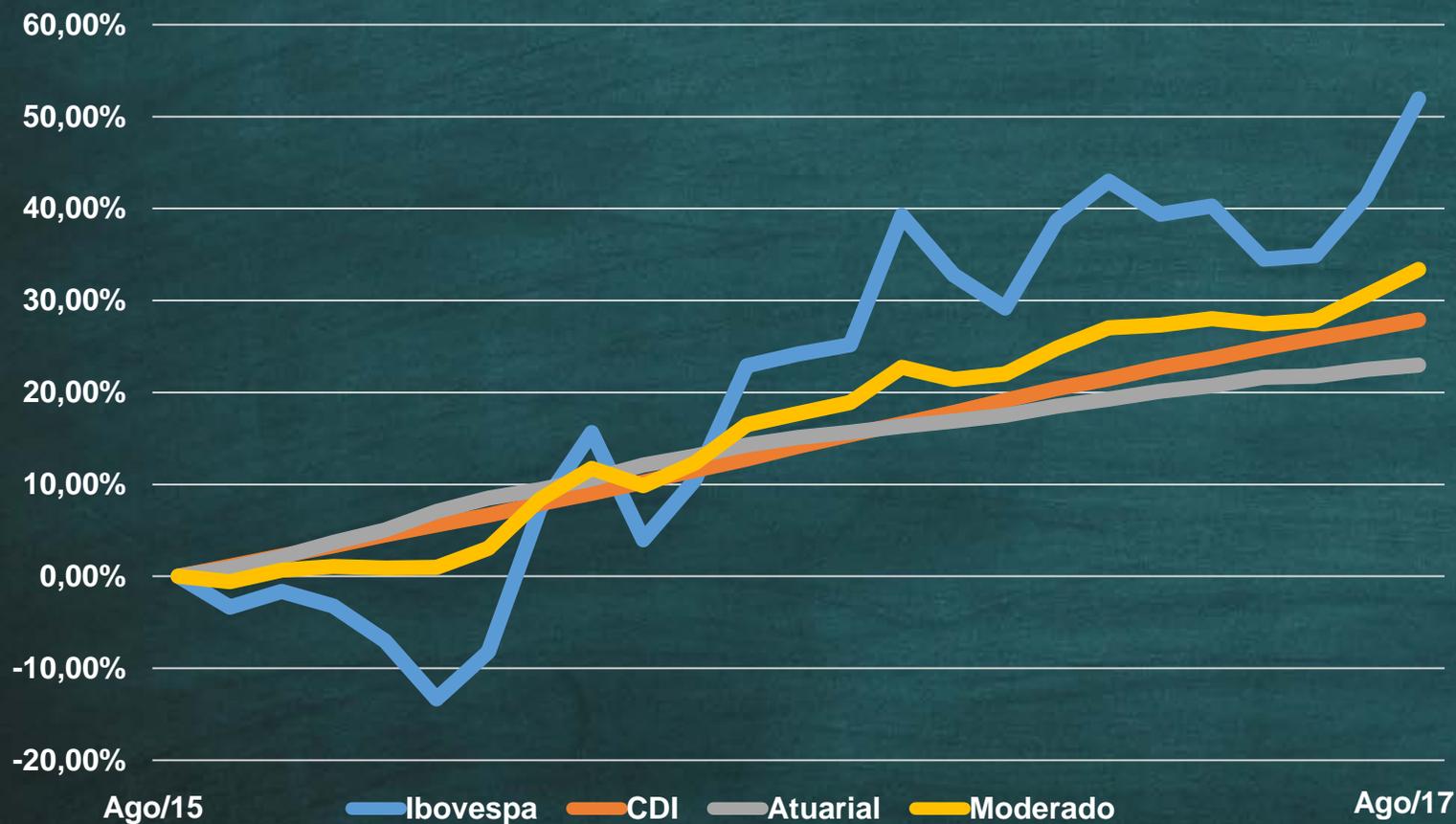
dos associados



Perfil Moderado

0% a 20% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Agosto de 2017

2,13%

Acumulado 2017

9,33%

Últimos 12 meses

13,30%

Últimos 24 meses

33,38%



Perfil de

2,91%

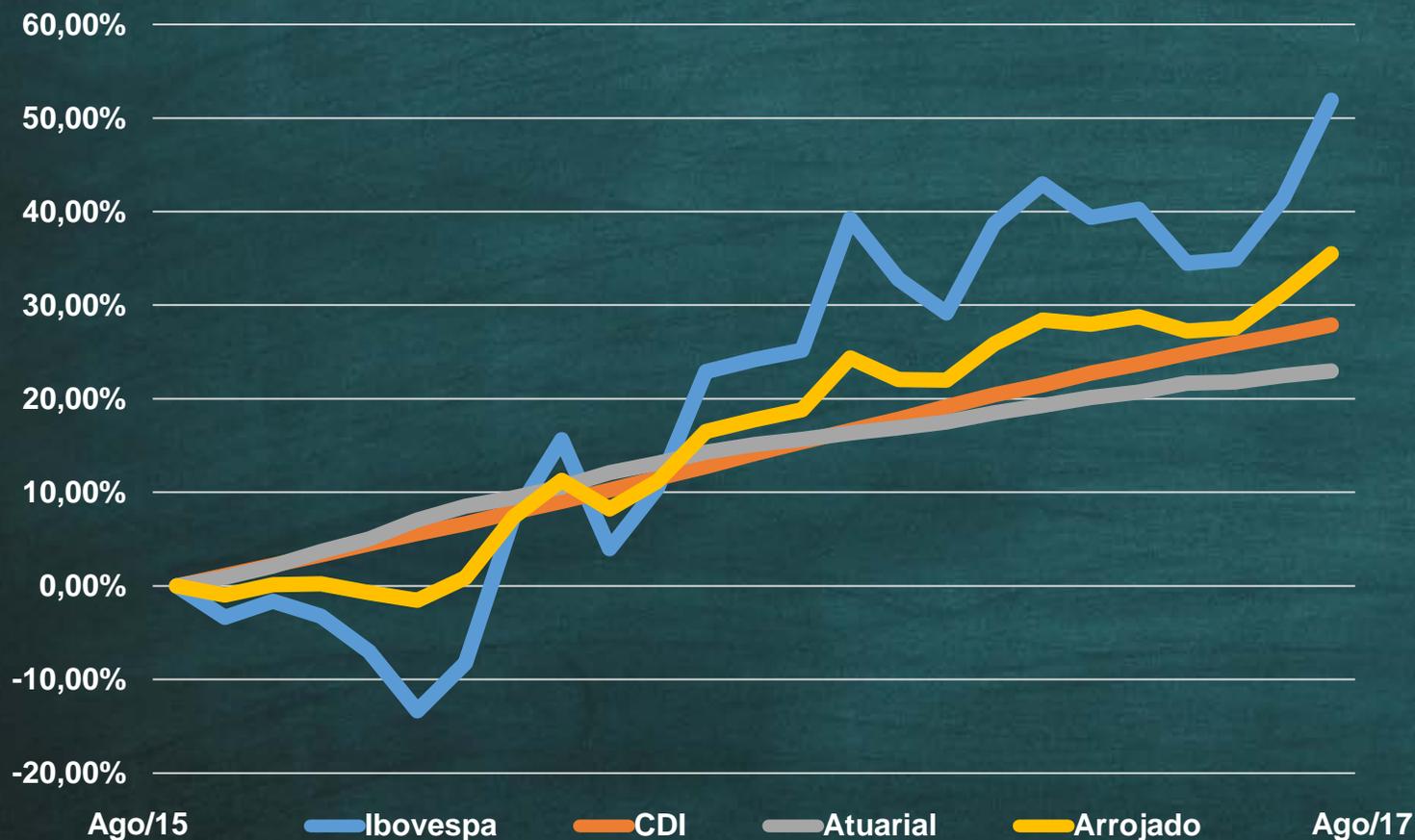
dos associados



Perfil Arrojado

20% a 40% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Agosto de 2017
3,20%
Acumulado 2017
11,09%
Últimos 12 meses
15,10%
Últimos 24 meses
35,51%



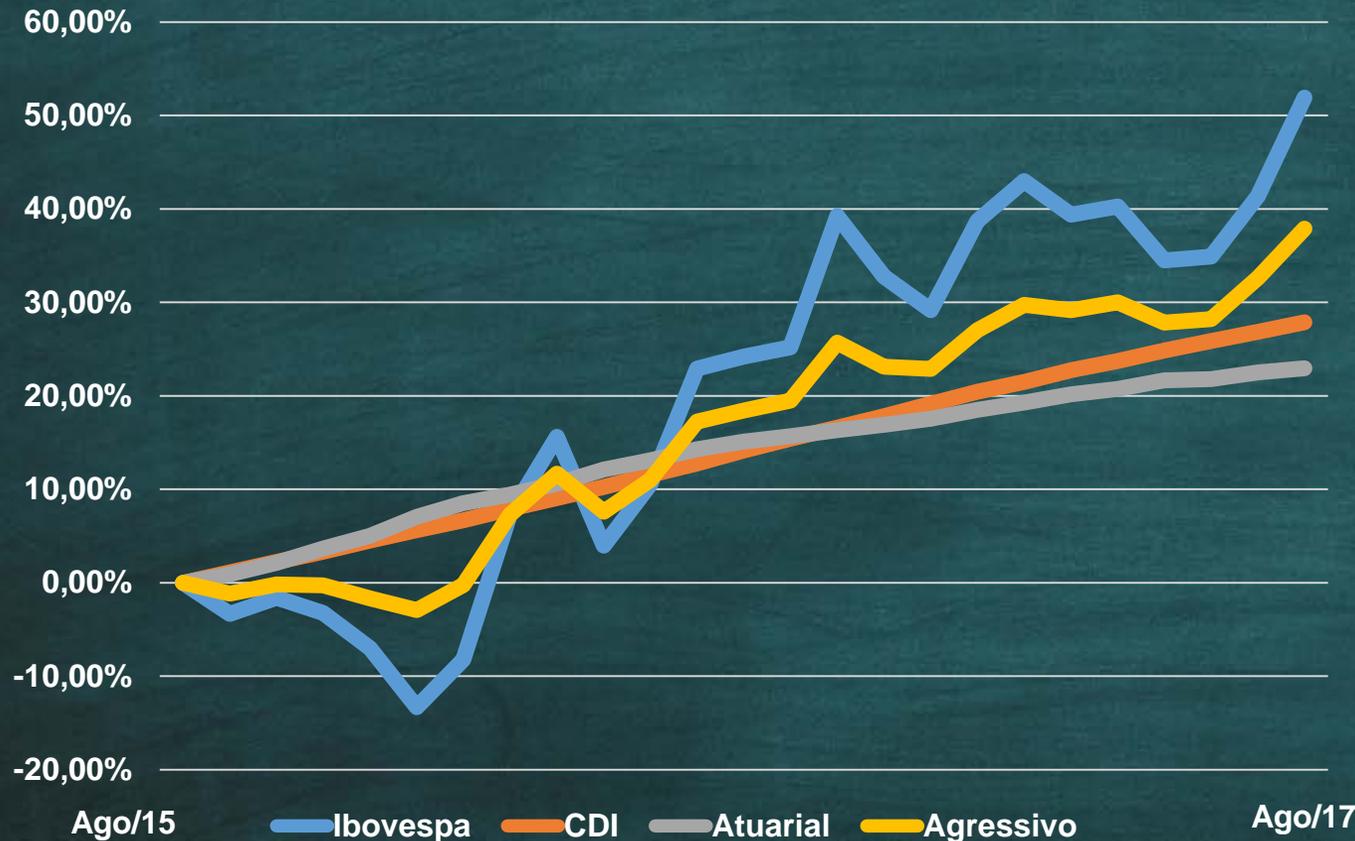
Perfil de
79,10%
dos associados



Perfil Agressivo

40% a 60% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Agosto de 2017
3,98%
Acumulado 2017
12,22%
Últimos 12 meses
16,43%
Últimos 24 meses
37,90%

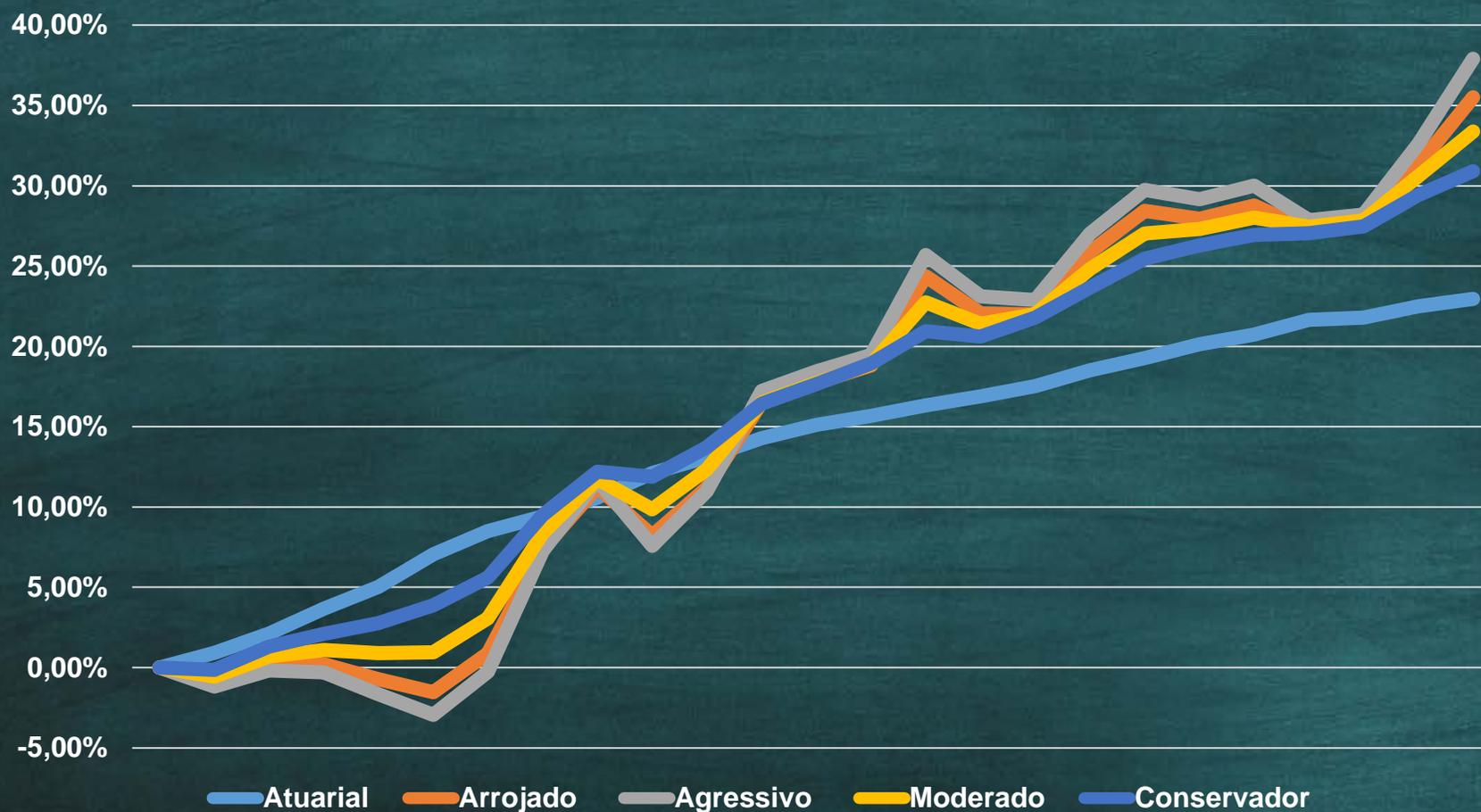


Perfil de
2,13%
dos associados



Perfis de Investimento

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses – Comparação entre os Perfis





[Fale Conosco](#)



0800 729 0505

