

Boletim de

DESEMPENHO

PREVI Futuro - Jul / 2018



+



=

Resultado

PREVI

Balço Patrimonial

Ativo

Onde estão aplicados todos os recursos do Plano PREVI Futuro



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Passivo



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

Meta:

INPC
+
5% a.a.

Distribuição da Carteira de Investimentos - Jul / 2018

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas



58,38%

Renda Variável



Investimentos em ações



24,58%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples



11,64%

Investimentos Imobiliários



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

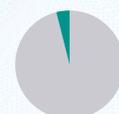


3,94%

Investimentos Estruturados



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



1,33%

Investimentos no Exterior



Aplicar ativos em países estrangeiros para obtenção de rentabilidade



0,13%

Balanço Patrimonial

Ativo

Onde estão aplicados todos os recursos do Plano PREVI Futuro



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Passivo



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

Meta acumulada em 2018:
5,80%

Distribuição da Carteira de Investimentos - Jul / 2018

Rentabilidade 2018: **5,41%** Valor de Mercado (mil) Jul / 2018: **13.070.833**

Renda Fixa



Rentabilidade 2018

5,32%

Valor Jul-2018 (mil)
7.631.137



Renda Variável



Rentabilidade 2018

4,15%

Valor Jul-2018 (mil)
3.212.571



Operações com Participantes



Rentabilidade 2018

4,47%

Valor Jul-2018 (mil)
1.521.420



Investimentos Imobiliários



Rentabilidade 2018

5,40%

Valor Jul-2018 (mil)
514.810



Investimentos Estruturados



Rentabilidade 2018

20,25%

Valor Jul-2018 (mil)
174.309



Investimentos no Exterior



Rentabilidade 2018

13,79%

Valor Jul-2018 (mil)
16.585



Abaixo da Meta

Acima da Meta



Rentabilidade Acumulada

Meta Atuarial
acumulada:
5,80%

	Valor (R\$ Mil)	Participação (%)	Rentabilidade de Julho %	Rentabilidade Acumulada em 2018
PREVI Futuro	13.070.833	100%	3,30%	5,41%
Renda Fixa	7.631.137	58,38%	1,72%	5,32%
Renda Variável	3.212.571	24,58%	8,75%	4,15%
Ações	3.160.571	98,38%	8,80%	4,29%
Fundos	51.999	1,62%	5,49%	-3,50%
Investimentos Estruturados	174.309	1,33%	6,37%	20,25%
Investimentos Exterior	16.585	0,13%	0,77%	13,79%
Investimentos Imobiliários	514.810	3,94%	0,43%	5,40%
Operações com Participantes	1.521.420	11,64%	0,83%	4,43%

Superávit/Déficit (R\$ Milhões)

37,4

37,7

Resultado Acumulado (R\$ Milhões)

189,7



Renda Fixa

confira a relação completa dos ativos da carteira



58,38%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade	
			Jul / 2018	Acumulado 2018
Renda Fixa	7.631.137	58,38%	1,72%	5,32%
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	3.210.776	42,07%	1,34%	6,72%
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.	2.589.123	33,93%	2,63%	3,33%
Caixa operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic.	324.471	4,25%	0,54%	3,74%
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.	701.631	9,19%	1,01%	5,71%
Títulos privados de instit. não financeiras títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias.	721.256	9,45%	1,53%	5,89%
Fundos de Investimentos RF	83.881	1,10%	0,86%	5,96%

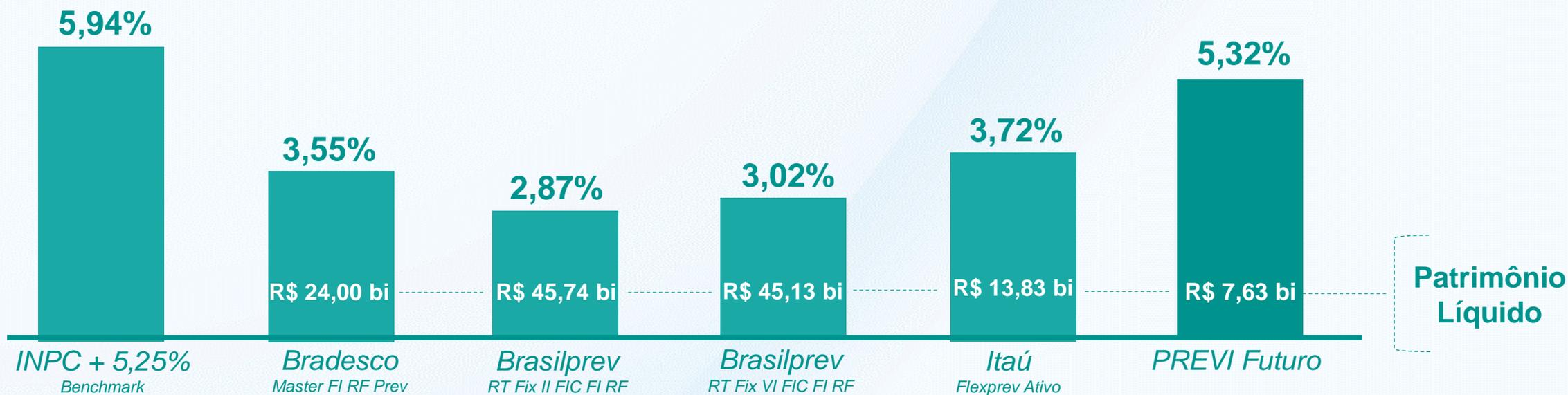


Eficiência Renda Fixa



58,38%

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



Fonte: site CVM.



Renda Variável

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

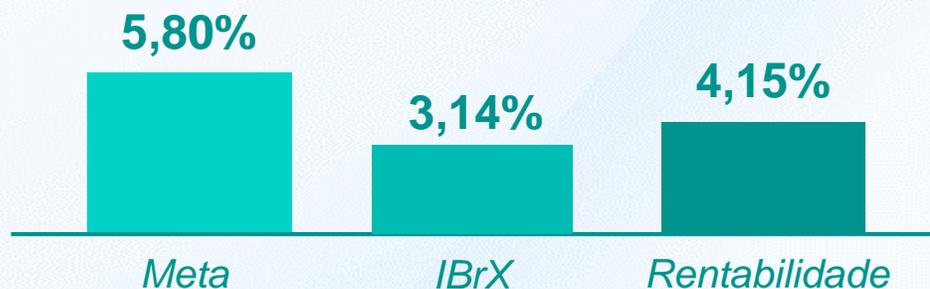


24,58%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Jul / 2018	Acum. 2018
Renda Variável	3.212.571	24,58%	8,75%	4,15%
Ações	3.160.571	98,38%	8,80%	4,29%
Fundos	51.999	1,62%	5,49%	-3,50%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

Valor Financeiro
(R\$ milhões)



24,58%

12 Maiores Ativos	Jul / 2018	% na carteira	% patrimônio total
VALE R DOCE ON N1	381,62	11,88%	2,92%
ITAUUNIBANCO PN N1	323,15	10,06%	2,47%
BRDESCO PN EG N1	216,92	6,75%	1,66%
PETROBRAS PN	183,27	5,70%	1,40%
AMBEV S/A ON	169,41	5,27%	1,30%
PETROBRAS ON	130,86	4,07%	1,00%
B3 ON NM	106,44	3,31%	0,81%
ITAUSA PN N1	102,43	3,19%	0,78%
BRASIL ON EG	87,71	2,73%	0,67%
LOJAS RENNER ON NM	59,43	1,85%	0,45%
BRDESCO ON EG N1	52,80	1,64%	0,40%
ULTRAPAR ON N1	47,10	1,47%	0,36%

Valor total da carteira
(R\$ milhões)

3.212,57

Valor dos 12 maiores ativos
(representa 56% da carteira)

1.861,14



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	106,78
ITAUUNIBANCO PN N1	85,79	453,43	35,57
BRADERCO PN EG N1	0,00	-234,22	0,13
PETROBRAS PN	77,51	-18,04	36,66
AMBEV S/A ON	-5,10	258,51	-14,65
PETROBRAS ON	52,89	-14,26	31,76
B3 ON NM	22,97	165,70	6,13
ITAUSA PN N1	33,40	20,95	11,29
BRASIL ON EG	21,75	134,21	3,74
LOJAS RENNER ON NM	9,97	23,82	-7,85
ULTRAPAR ON N1	11,72	111,32	-39,65
SUZANO PAPEL ON I10 N1	-	-	26,83
Variação Anual (R\$ milhões)	↑ 377,94	↑ 758,73	↑ 106,85



Operações com Participantes



11,64%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Jul / 2018	Acum. 2018
Empréstimos e Financiamentos	1.521.420	11,64%	0,83%	4,47%
Empréstimos Simples	1.319.786	86,75%	0,84%	4,51%
Financiamentos	201.634	13,25%	0,80%	4,18%



Investimentos Imobiliários

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



3,94%

Valor de Mercado (R\$ Mil)

514.810

Rentabilidade

Jul / 2018

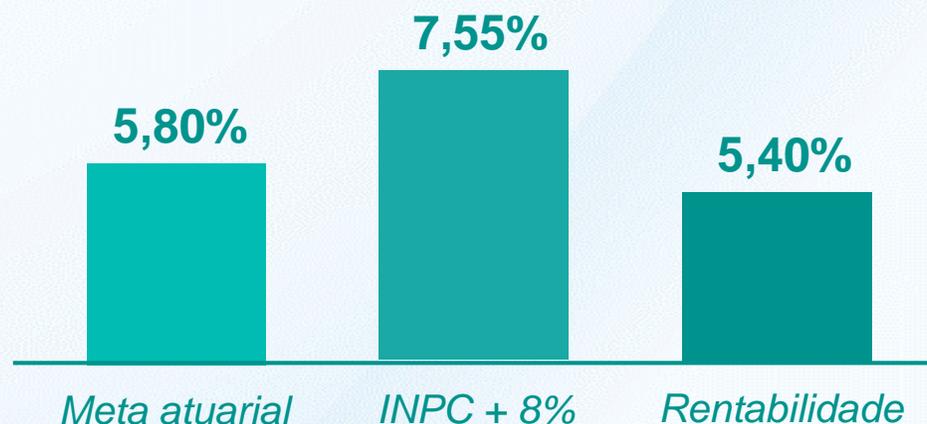
0,43%

Acumulado 2018

5,40%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos Estruturados

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

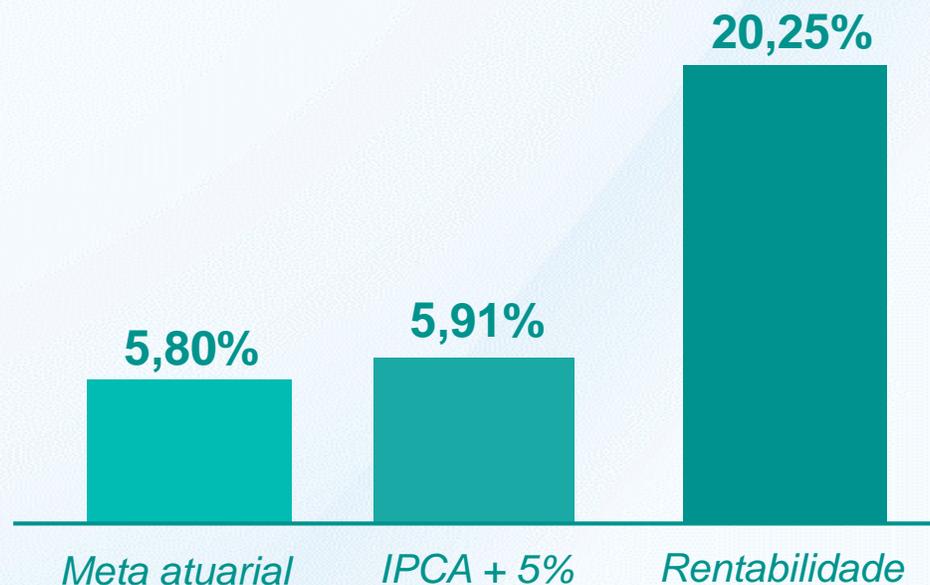


1,33%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Jul / 2018	Acumulado 2018
174.309	6,37%	20,25%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

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

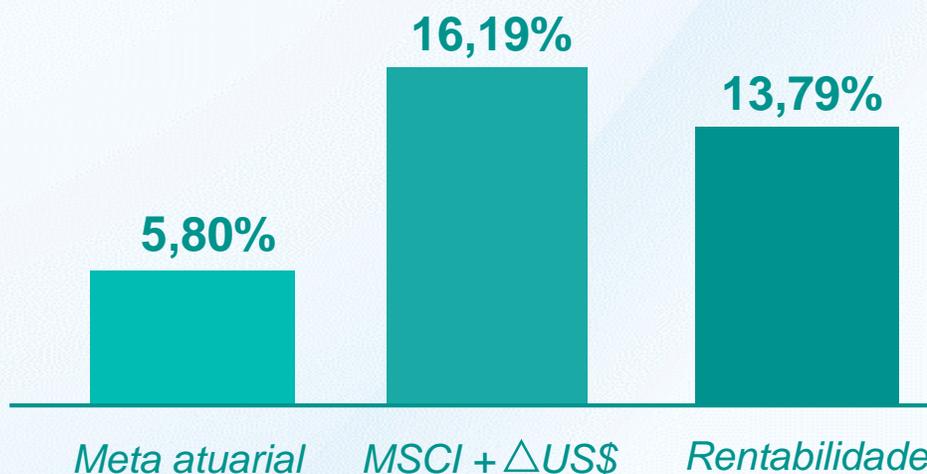


0,13%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Jul / 2018	Acumulado 2018
16.585	0,77%	13,79%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade



Perfil do Investidor

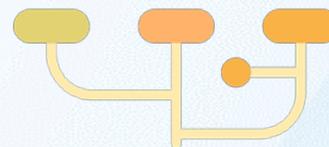
[Quer saber qual é o seu? Acesse o autoatendimento do site da PREVI >> Perfis de Investimento e preencha o questionário de Análise do Perfil do Investidor \(API\)](#)

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

Julho de 2018

1,53%

Acumulado 2018

5,10%

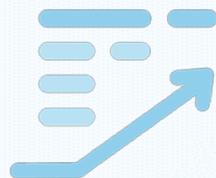
Últimos 12 meses

8,96%

Últimos 24 meses

21,13%

Moderado
0% a 20% em RV



Rentabilidade

Julho de 2018

2,44%

Acumulado 2018

5,23%

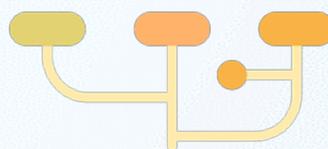
Últimos 12 meses

11,19%

Últimos 24 meses

24,64%

Arrojado
20% a 40% em RV



Rentabilidade

Julho de 2018

3,77%

Acumulado 2018

5,20%

Últimos 12 meses

13,24%

Últimos 24 meses

27,61%

Agressivo
40% a 60% em RV



Rentabilidade

Julho de 2018

4,49%

Acumulado 2018

5,30%

Últimos 12 meses

15,03%

Últimos 24 meses

30,13%

Meta

**INPC +
5% a.a.**

Julho de 2018

0,66%

Acumulado 2018

5,80%

Últimos 12 meses

8,79%

Últimos 24 meses

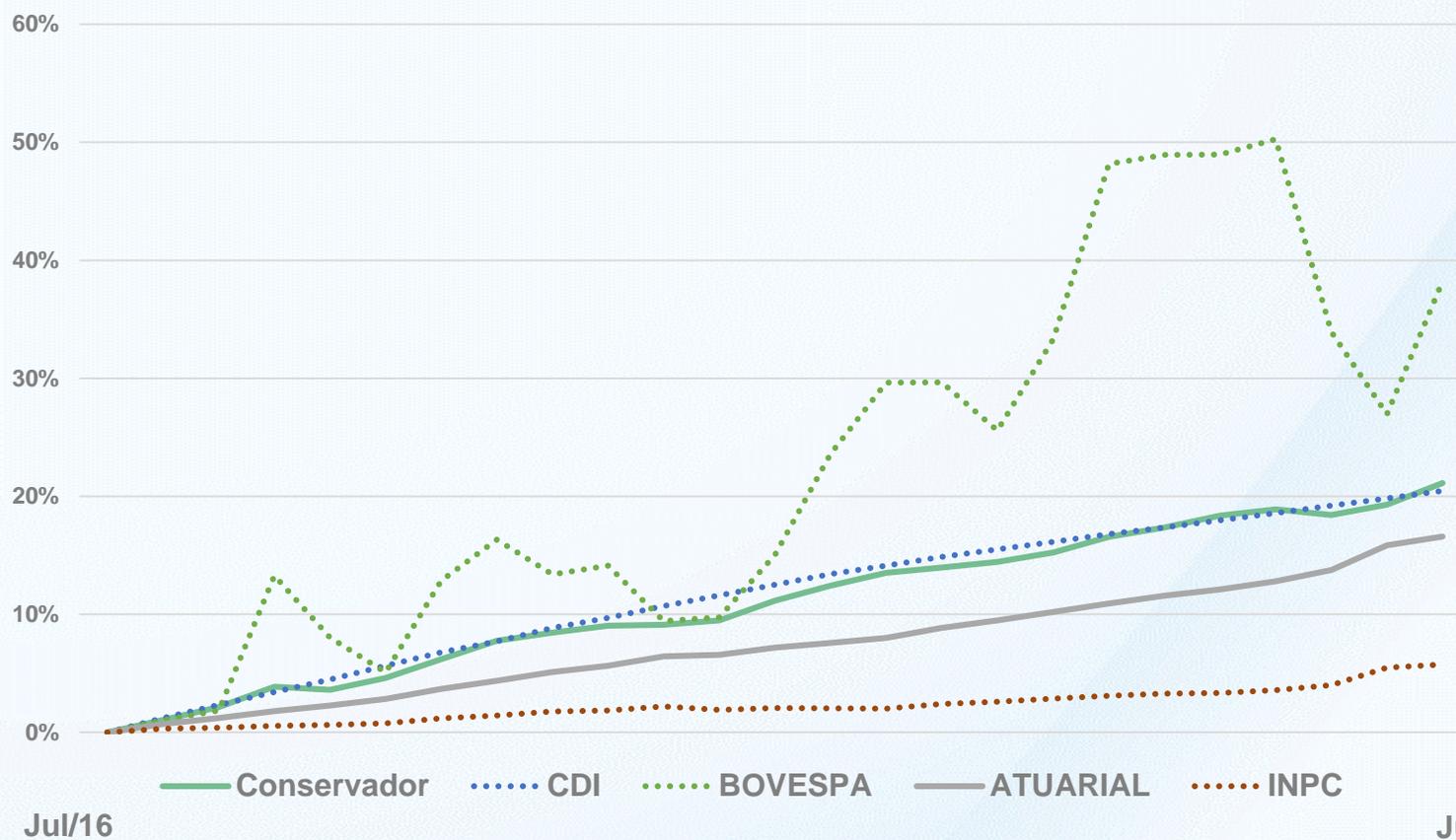
16,60%



Perfil Conservador

0% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Julho de 2018

1,53%

Acumulado 2018

5,10%

Últimos 12 meses

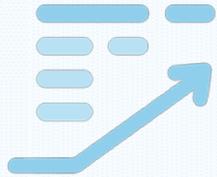
8,96%

Últimos 24 meses

21,13%



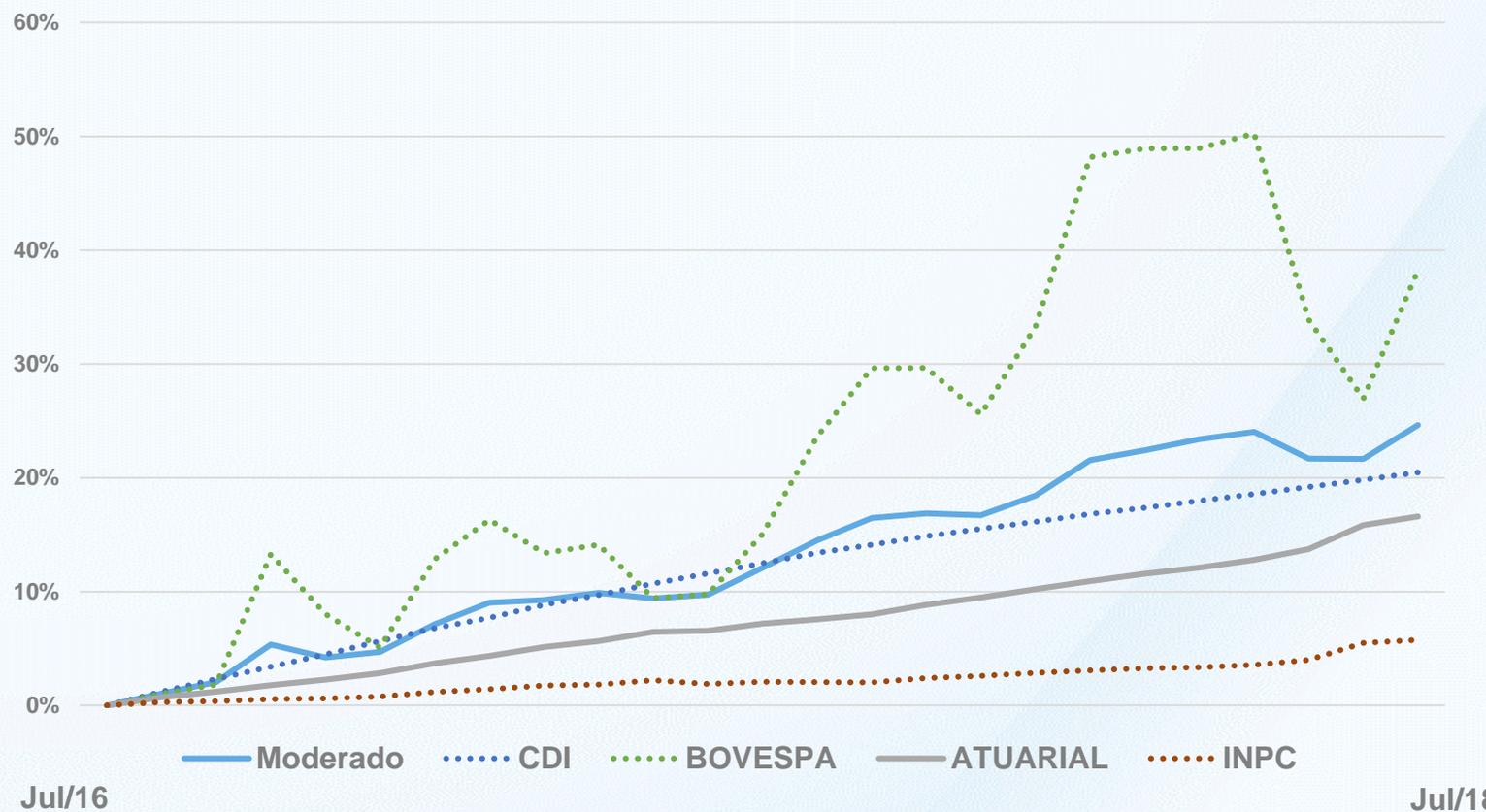
Perfil de
12,49%
dos associados



Perfil Moderado

0% a 20% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Julho de 2018

2,44%

Acumulado 2018

5,23%

Últimos 12 meses

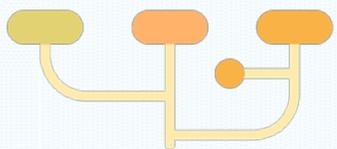
11,19%

Últimos 24 meses

24,64%



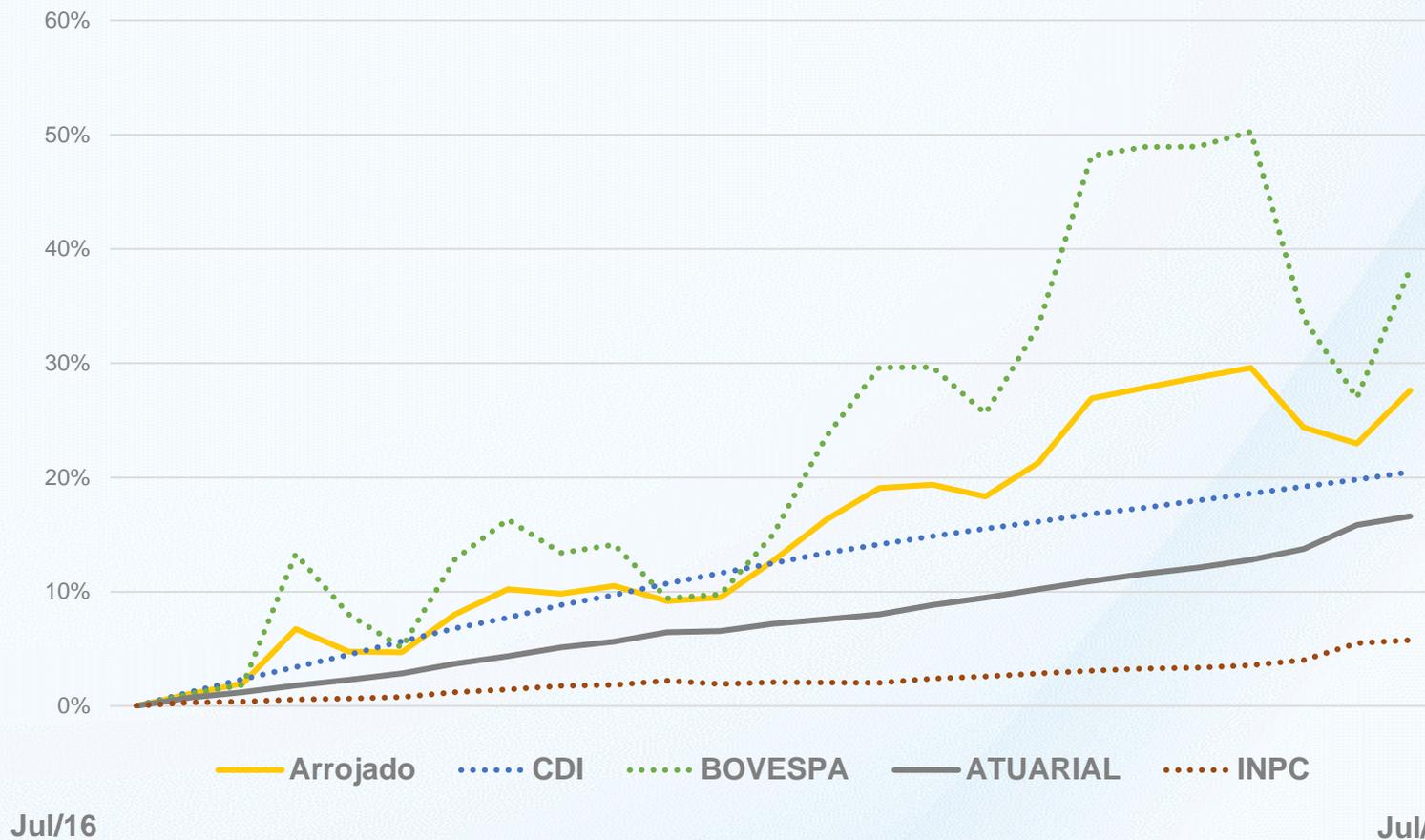
Perfil de
5,39%
dos associados



Perfil Arrojado

20% a 40% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Julho de 2018

3,77%

Acumulado 2018

5,20%

Últimos 12 meses

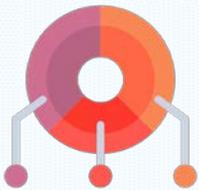
13,24%

Últimos 24 meses

27,61%



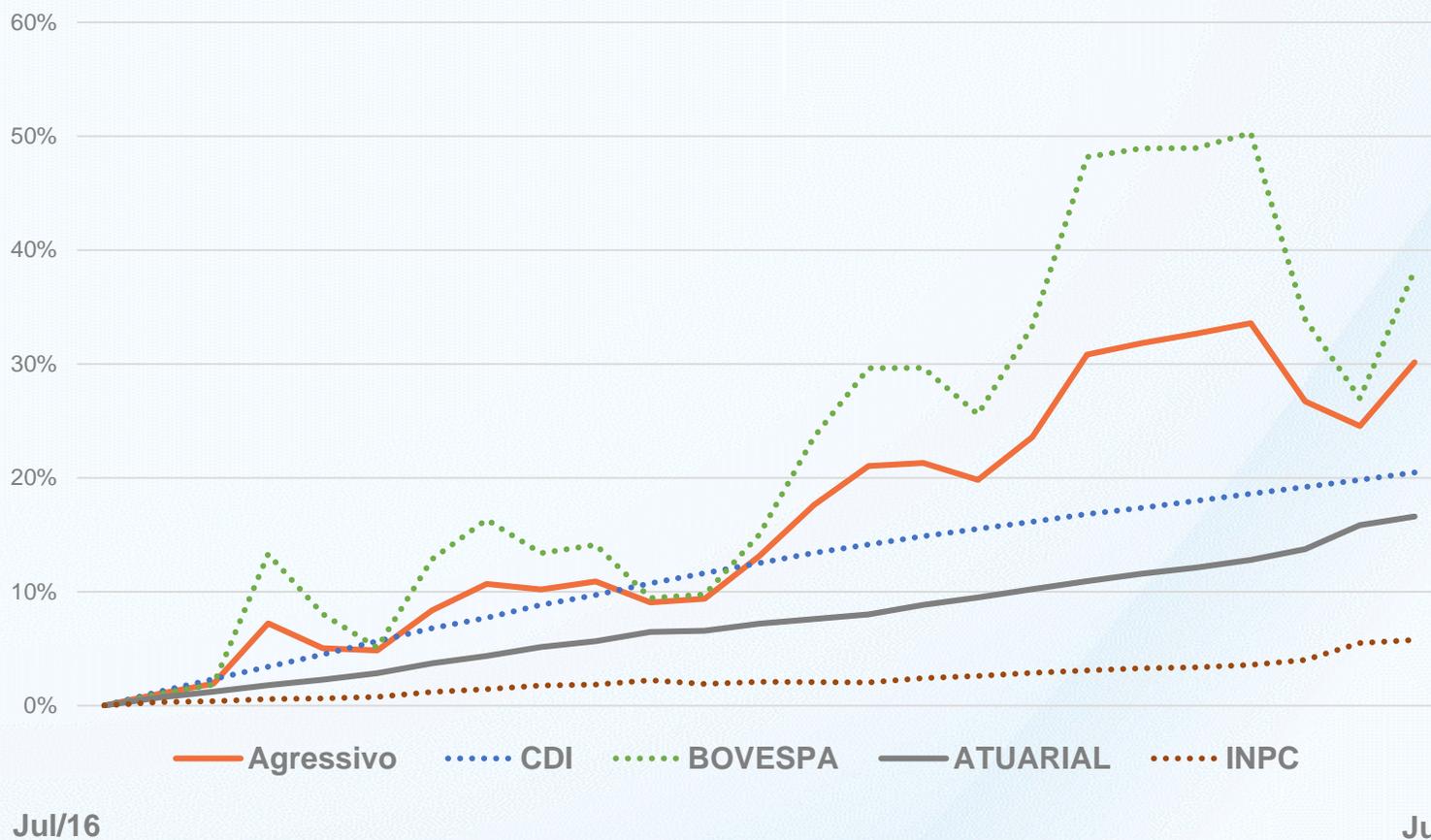
Perfil de
78,65%
dos associados



Perfil Agressivo

40% a 60% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Julho de 2018

4,49%

Acumulado 2018

5,30%

Últimos 12 meses

15,03%

Últimos 24 meses

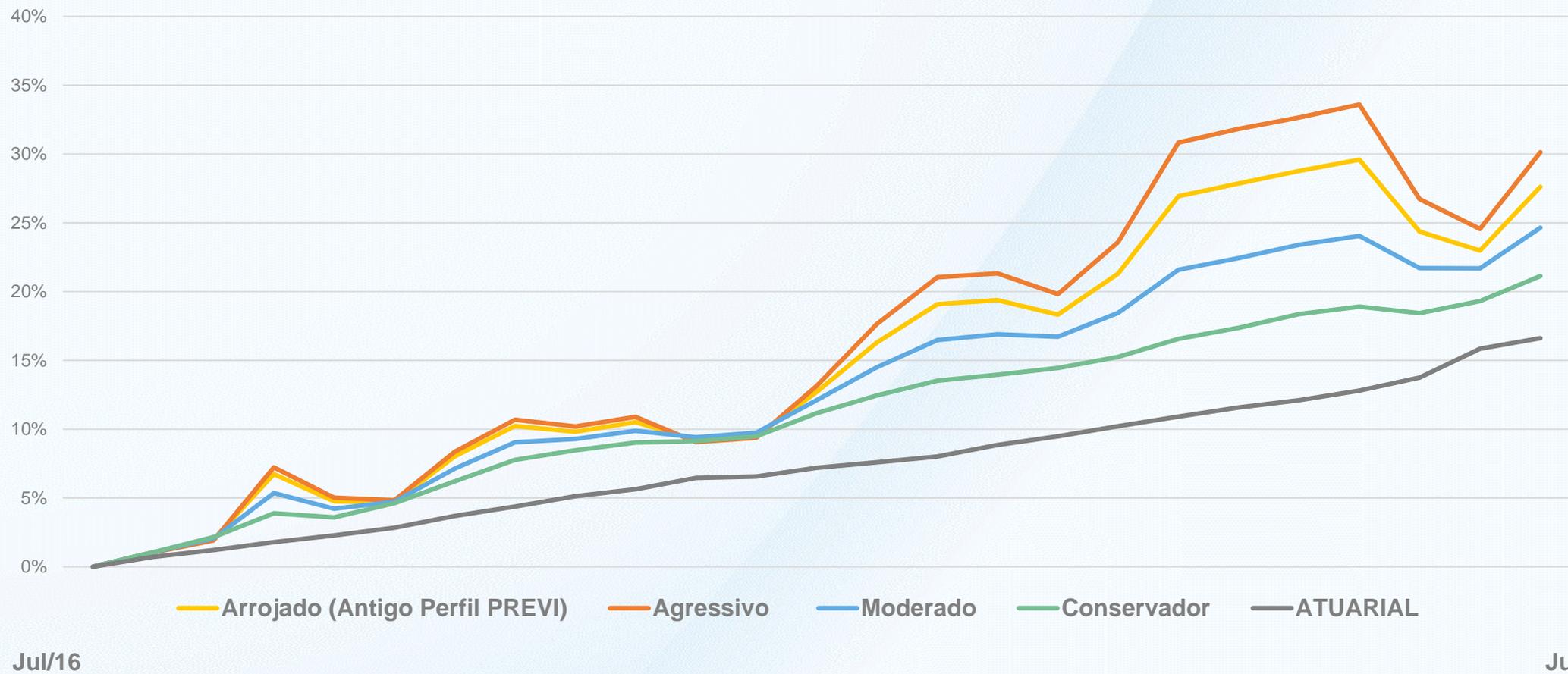
30,13%



Perfil de
3,48%
dos associados

Perfis de Investimentos

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses – Comparação entre os Perfis





[Fale Conosco](#)



0800 729 0505



[Canal Web](#)

OUVIR
SUA VOZ.

0800 729 0303