

Boletim de

DESEMPENHO

PREVI Futuro - Jun / 2018



+



=

Resultado



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:

INPC
+
5% a.a.

Distribuição da Carteira de Investimentos - Jun / 2018

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas

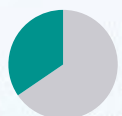


58,67%

Renda Variável



Investimentos em ações



23,89%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples



11,91%

Investimentos Imobiliários



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

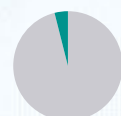


4,10%

Investimentos Estruturados



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

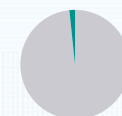


1,30%

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:
5,10%

Distribuição da Carteira de Investimentos - Jun / 2018

Rentabilidade 2018: **2,04%** Valor de Mercado (mil) Jun / 2018: **12.558.140** ●

Renda Fixa



Rentabilidade 2018

3,54%

Valor Jun-2018 (mil)
7.368.106



Renda Variável



Rentabilidade 2018

-4,22%

Valor Jun-2018 (mil)
3.000.386



Operações com Participantes



Rentabilidade 2018

3,61%

Valor Jun-2018 (mil)
1.495.218



Investimentos Imobiliários



Rentabilidade 2018

4,95%

Valor Jun-2018 (mil)
514.810



Investimentos Estruturados



Rentabilidade 2018

13,05%

Valor Jun-2018 (mil)
163.162



Investimentos no Exterior



Rentabilidade 2018

12,92%

Valor Jun-2018 (mil)
16.459



● Abaixo da Meta

● Acima da Meta



Rentabilidade Acumulada

Meta Atuarial
acumulada:
5,10%

	Valor (R\$ Mil)	Participação (%)	Rentabilidade de Junho %	Rentabilidade Acumulada em 2018
PREVI Futuro	12.558.140	100%	-0,70%	2,04%
Renda Fixa	7.368.106	58,67%	0,73%	3,54%
Renda Variável	3.000.386	23,89%	-5,05%	-4,22%
Ações	2.951.094	98,36%	-5,06%	-4,15%
Fundos	49.293	1,64%	-3,95%	-8,53%
Investimentos Estruturados	163.162	1,30%	-0,10%	13,05%
Investimentos Exterior	16.459	0,13%	3,74%	12,92%
Investimentos Imobiliários	514.810	4,10%	1,02%	4,95%
Operações com Participantes	1.495.218	11,91%	0,62%	3,61%

Superávit/Déficit (R\$ Milhões)

12,2

0,3

Resultado Acumulado (R\$ Milhões)

152,3



Renda Fixa

confira a relação completa dos ativos da carteira



58,67%

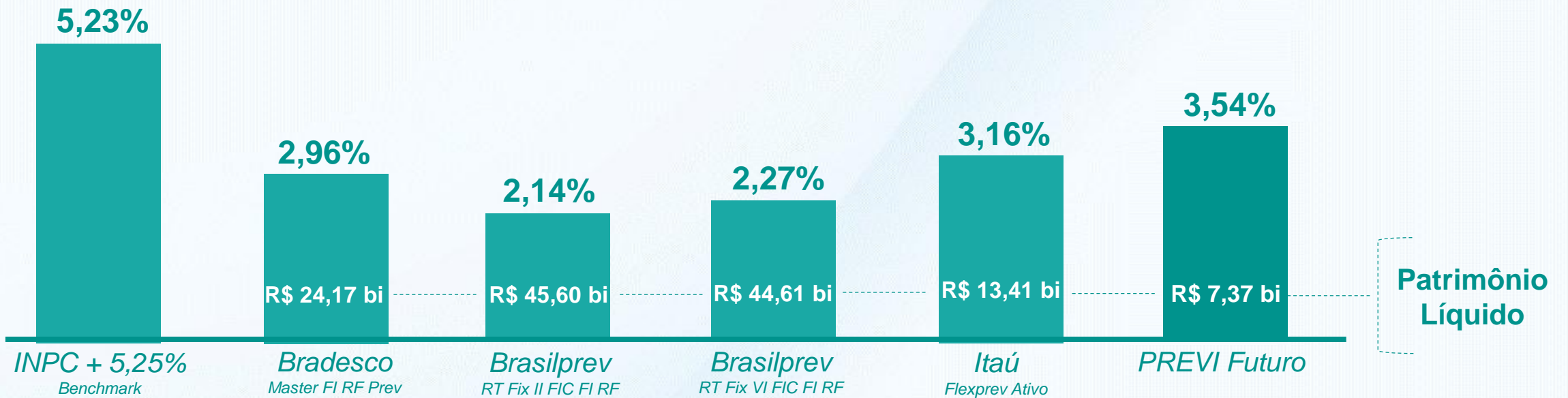
Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade	
			Jun / 2018	Acumulado 2018
Renda Fixa	7.368.106	58,67%	0,73%	3,54%
Títulos públicos mantidos até o vencimento títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional que têm seu valor nominal atualizado diariamente, pela sua taxa de juros. Ex: NTN-B	3.168.454	43,00%	1,37%	5,31%
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.	2.428.773	32,96%	-0,49%	0,68%
Caixa operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic.	315.339	4,28%	0,52%	3,18%
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.	694.607	9,43%	1,04%	4,65%
Títulos privados de instit. não financeiras títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias.	687.196	9,33%	1,27%	4,30%
Fundos de Investimentos RF	73.738	1,00%	1,05%	5,06%



Eficiência Renda Fixa

58,67%

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



Fonte: site CVM.



Renda Variável

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

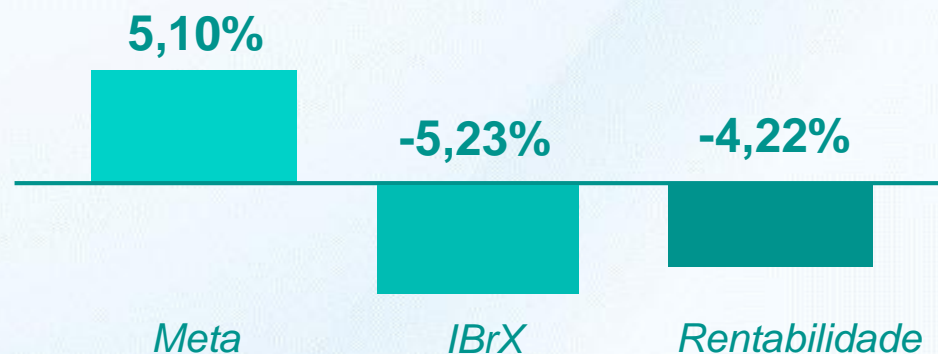


23,89%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Jun / 2018	Acum. 2018
Renda Variável	3.000.386	23,89%	-5,05%	-4,22%
Ações	2.951.094	98,36%	-5,06%	-4,15%
Fundos	49.293	1,64%	-3,95%	-8,53%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

Valor Financeiro
(R\$ milhões)



23,89%

12 Maiores Ativos	Jun / 2018	% na carteira	% patrimônio total
VALE R DOCE ON N1	350,04	11,67%	2,79%
ITAUNIBANCO PN N1	292,81	9,76%	2,33%
BRDESCO PN EG N1	194,73	6,49%	1,55%
PETROBRAS PN	162,81	5,43%	1,30%
AMBEV S/A ON	159,99	5,33%	1,27%
PETROBRAS ON	118,06	3,93%	0,94%
B3 ON NM	93,20	3,11%	0,74%
ITAUSA PN N1	87,39	2,91%	0,70%
BRASIL ON EG	78,78	2,63%	0,63%
LOJAS RENNER ON NM	55,08	1,84%	0,44%
ULTRAPAR ON N1	54,23	1,81%	0,43%
SUZANO PAPEL ON I10 N1	47,12	1,57%	0,38%

Valor total da carteira
(R\$ milhões)

3.000,39

Valor dos 12 maiores ativos
(representa 56,47% da carteira)

1.694,24



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	69,74
ITAUUNIBANCO PN N1	85,79	453,43	1,45
BRDESCO PN EG N1	0,00	-234,22	-27,63
PETROBRAS PN	77,51	-18,04	12,67
AMBEV S/A ON	-5,10	258,51	-27,28
PETROBRAS ON	52,89	-14,26	16,43
B3 ON NM	22,97	165,70	-9,09
ITAUSA PN N1	33,40	20,95	-0,37
BRASIL ON EG	21,75	134,21	-6,89
LOJAS RENNER ON NM	9,97	23,82	-10,73
ULTRAPAR ON N1	11,72	111,32	-33,49
SUZANO PAPEL ON I10 N1	-	-	27,31
Variação Anual (R\$ milhões)	↑ 377,94	↑ 758,73	↑ 12,12



Operações com Participantes



11,91%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Jun / 2018	Acum. 2018
Empréstimos e Financiamentos	1.495.218	11,91%	0,62%	3,61%
Empréstimos Simples	1.301.543	87,05%	0,62%	3,64%
Financiamentos	193.675	12,95%	0,63%	3,35%



Investimentos Imobiliários

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



4,10%

Valor de Mercado (R\$ Mil)

Rentabilidade

Jun / 2018

Acumulado 2018

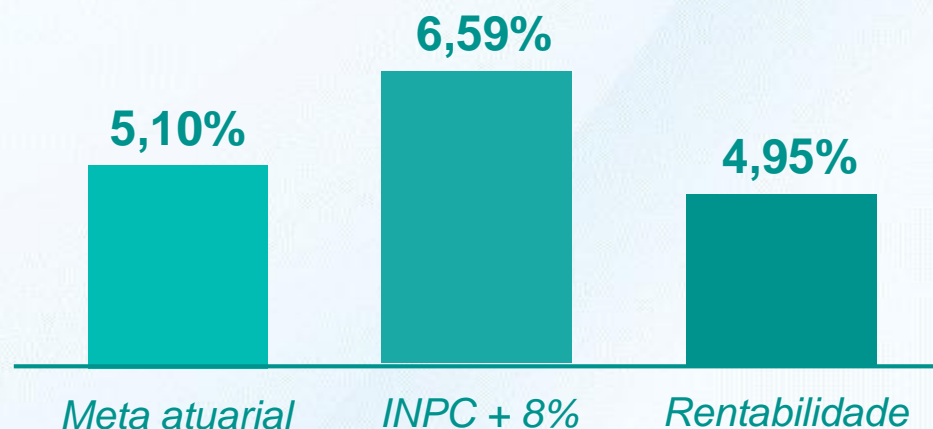
514.810

1,02%

4,95%

Eficiência Comparada

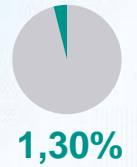
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos Estruturados

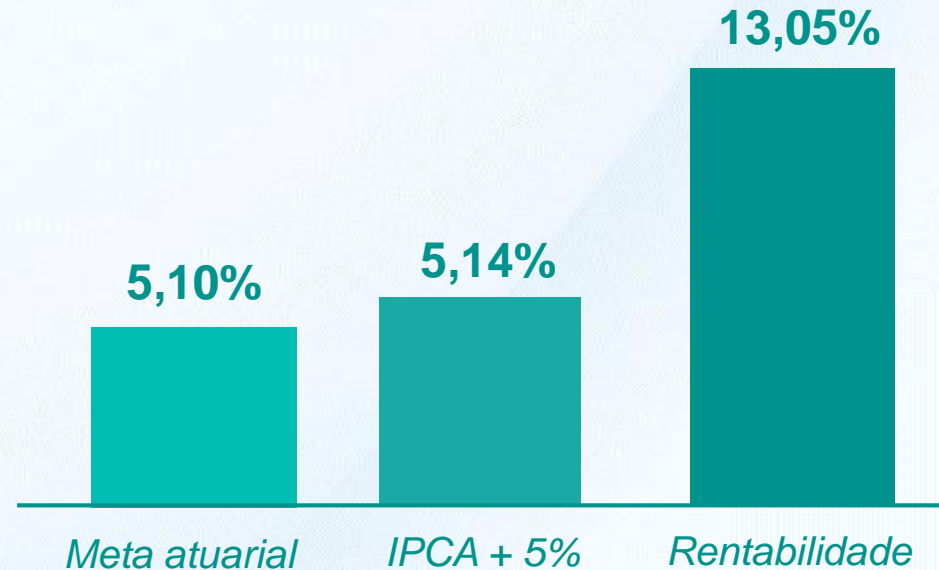
confira a relação completa dos ativos da carteira



Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Jun / 2018	Acumulado 2018
163.162	-0,10%	13,05%

Eficiência Comparada

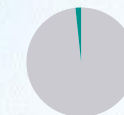
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

confira a relação completa dos ativos da carteira

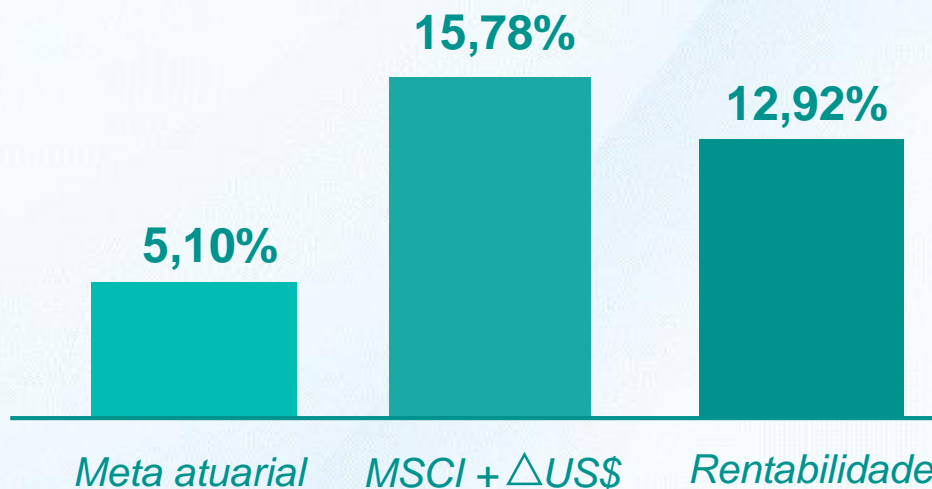


0,13%

Valor de Mercado (R\$ Mil)	Rentabilidade	
	Jun / 2018	Acumulado 2018
16.459	3,74%	12,92%

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

Junho de 2018

0,73%

Acumulado 2018

3,51%

Últimos 12 meses

8,97%

Últimos 24 meses

22,14%

Moderado
0% a 20% em RV



Rentabilidade

Junho de 2018

-0,01%

Acumulado 2018

2,73%

Últimos 12 meses

10,88%

Últimos 24 meses

26,19%

Arrojado
20% a 40% em RV



Rentabilidade

Junho de 2018

-1,12%

Acumulado 2018

1,38%

Últimos 12 meses

12,31%

Últimos 24 meses

28,86%

Agressivo
40% a 60% em RV



Rentabilidade

Junho de 2018

-1,72%

Acumulado 2018

0,78%

Últimos 12 meses

13,87%

Últimos 24 meses

31,54%

Meta

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

Junho de 2018

1,84%

Acumulado 2018

5,10%

Últimos 12 meses

8,70%

Últimos 24 meses

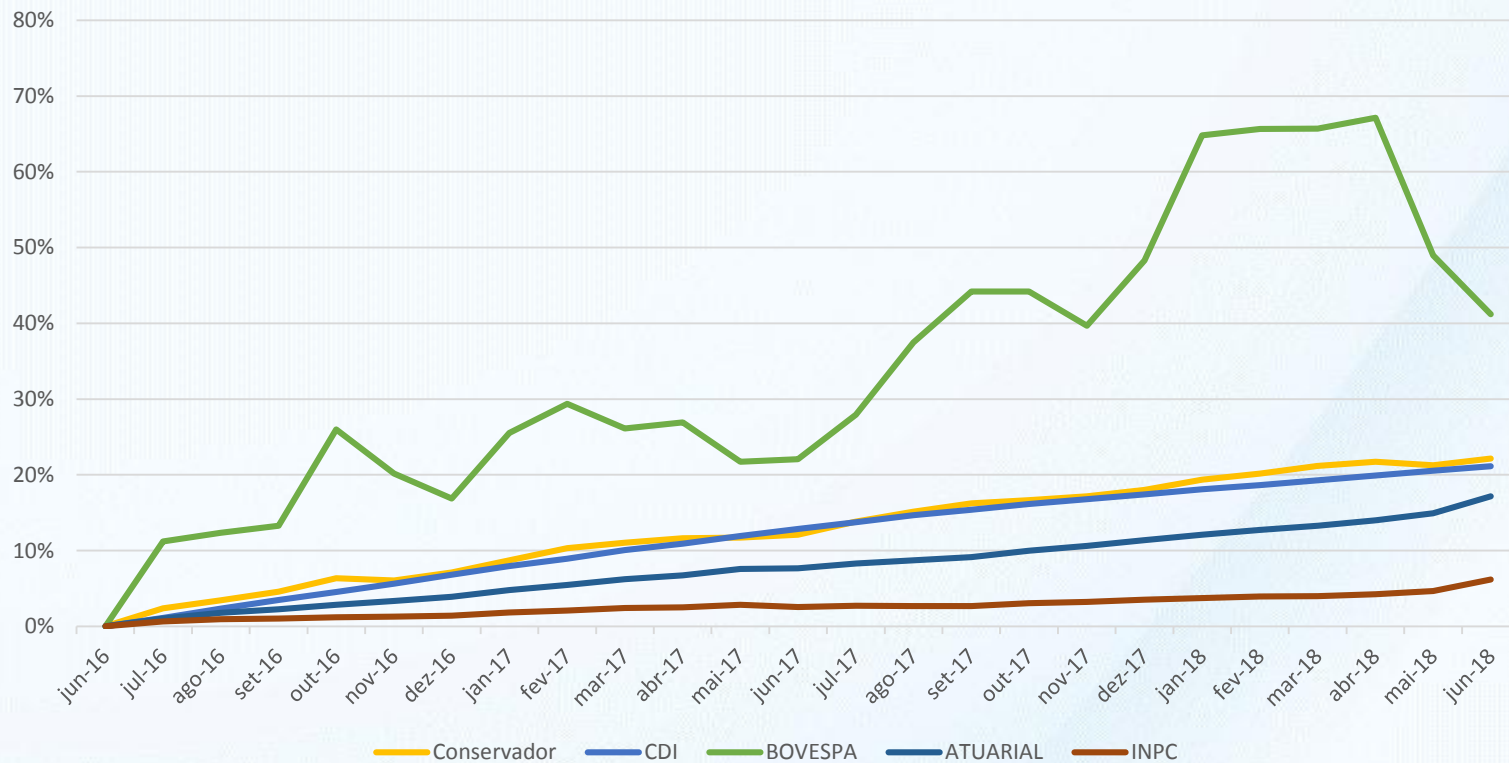
17,06%



Perfil Conservador

0% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Jun/16

Jun/18

Rentabilidade

Junho de 2018

0,73%

Acumulado 2018

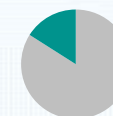
3,51%

Últimos 12 meses

8,97%

Últimos 24 meses

22,14%



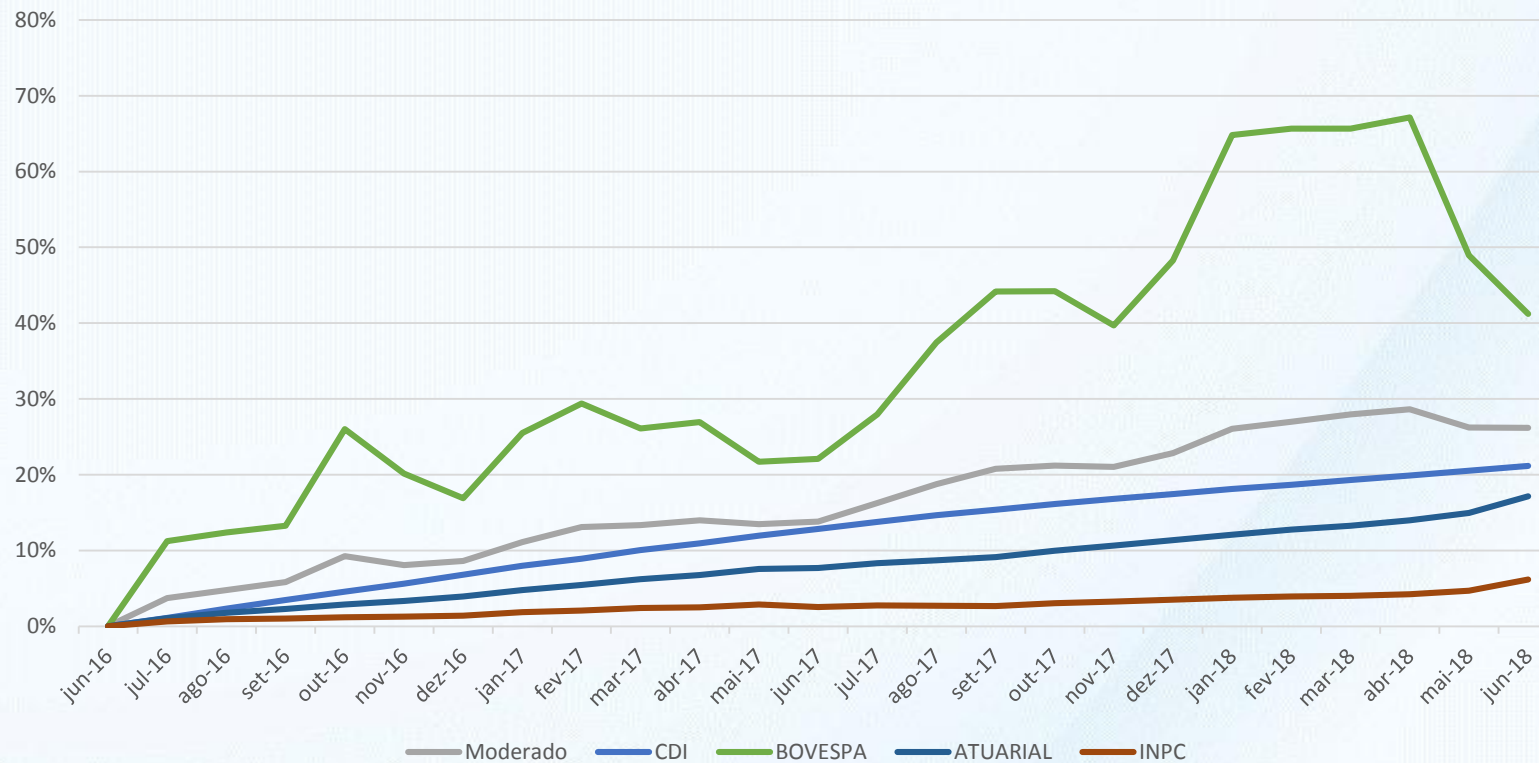
Perfil de
12,48%
dos associados



Perfil Moderado

0% a 20% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Jun/16

Jun/18

Rentabilidade

Junho de 2018

-0,01%

Acumulado 2018

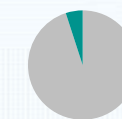
2,73%

Últimos 12 meses

10,88%

Últimos 24 meses

26,19%



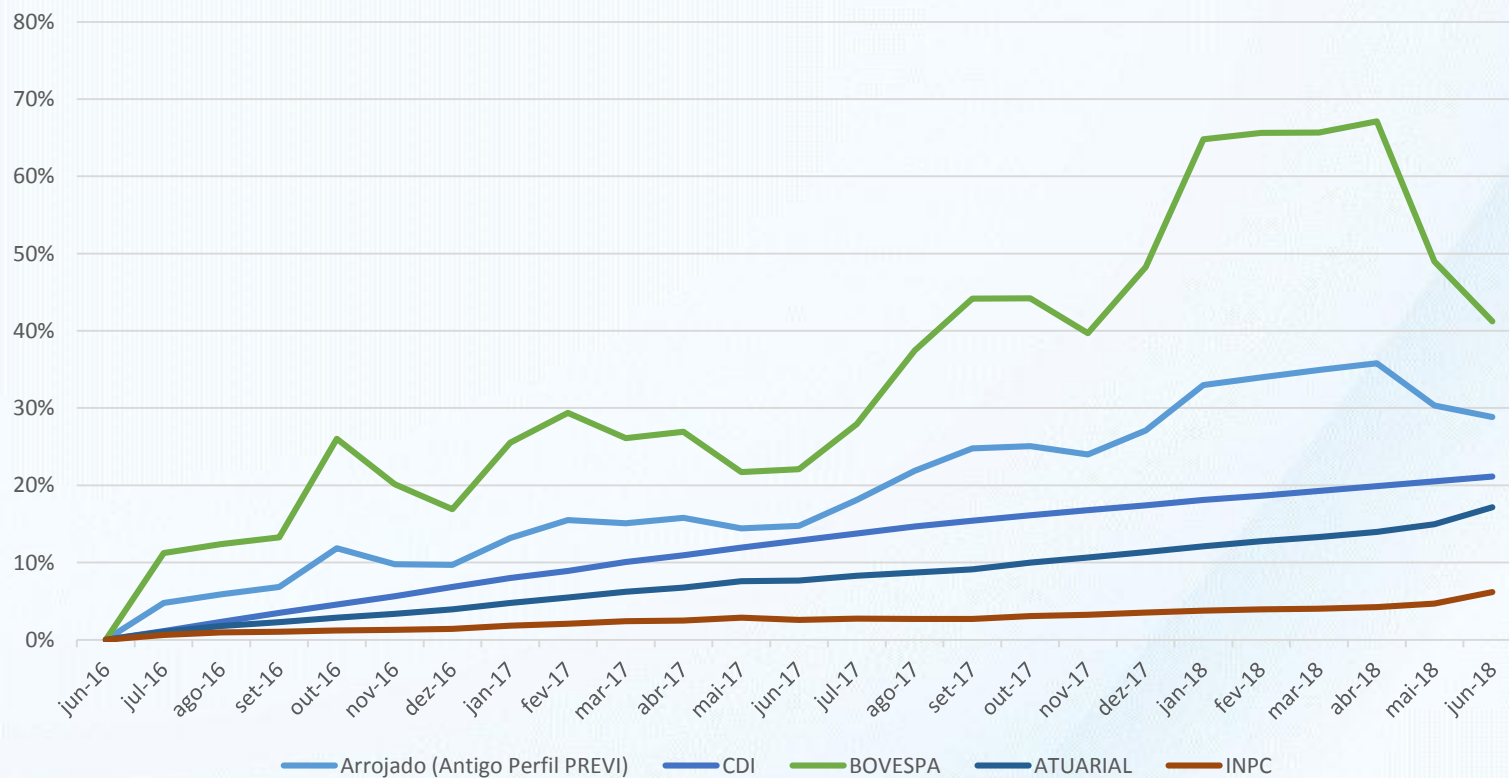
Perfil de
5,36%
dos associados



Perfil Arrojado

20% a 40% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Jun/16

Jun/18

Rentabilidade

Junho de 2018

-1,12%

Acumulado 2018

1,38%

Últimos 12 meses

12,31%

Últimos 24 meses

28,86%



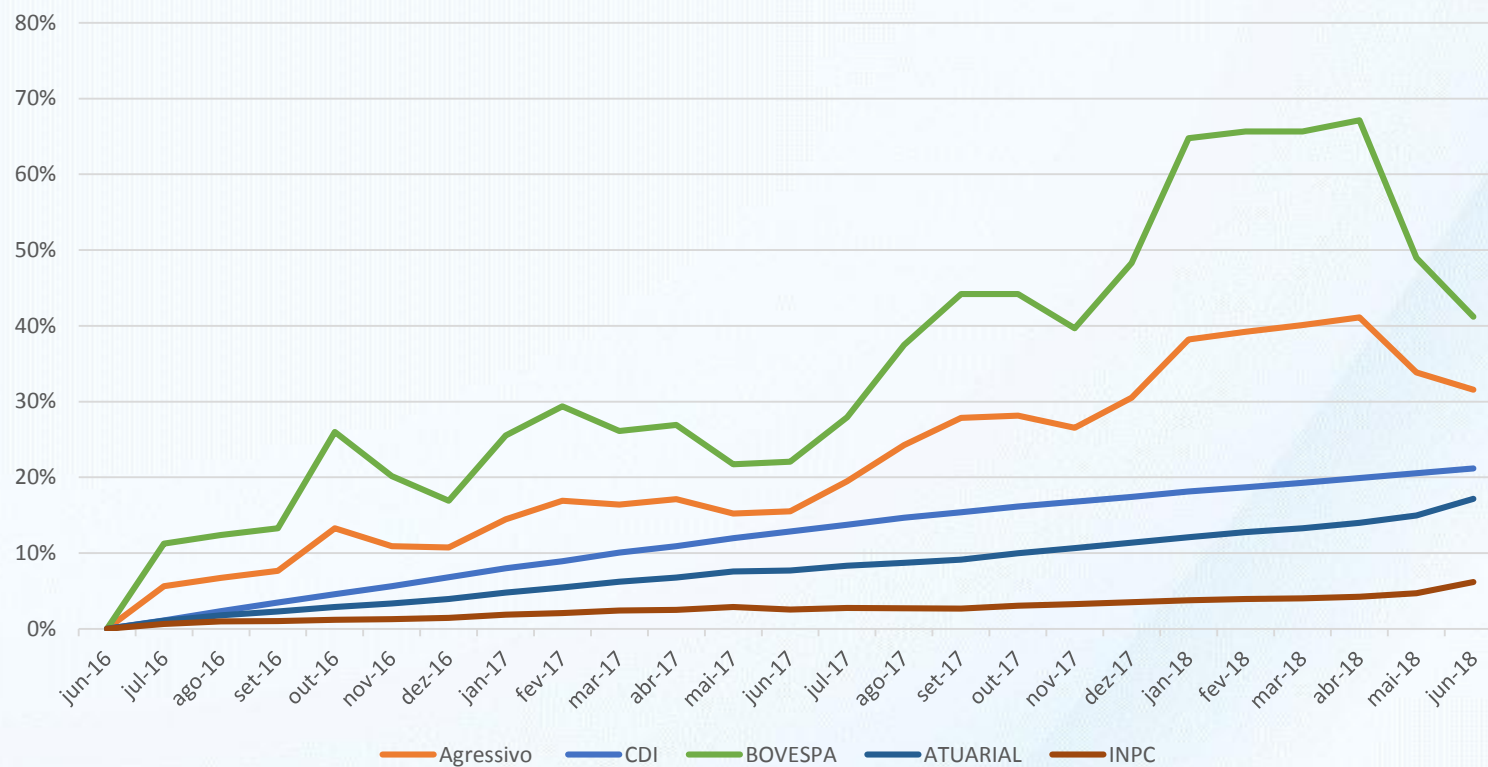
Perfil de
78,69%
dos associados



Perfil Agressivo

40% a 60% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Jun/16

Jun/18

Rentabilidade

Junho de 2018

-1,72%

Acumulado 2018

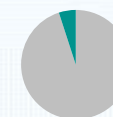
0,78%

Últimos 12 meses

13,87%

Últimos 24 meses

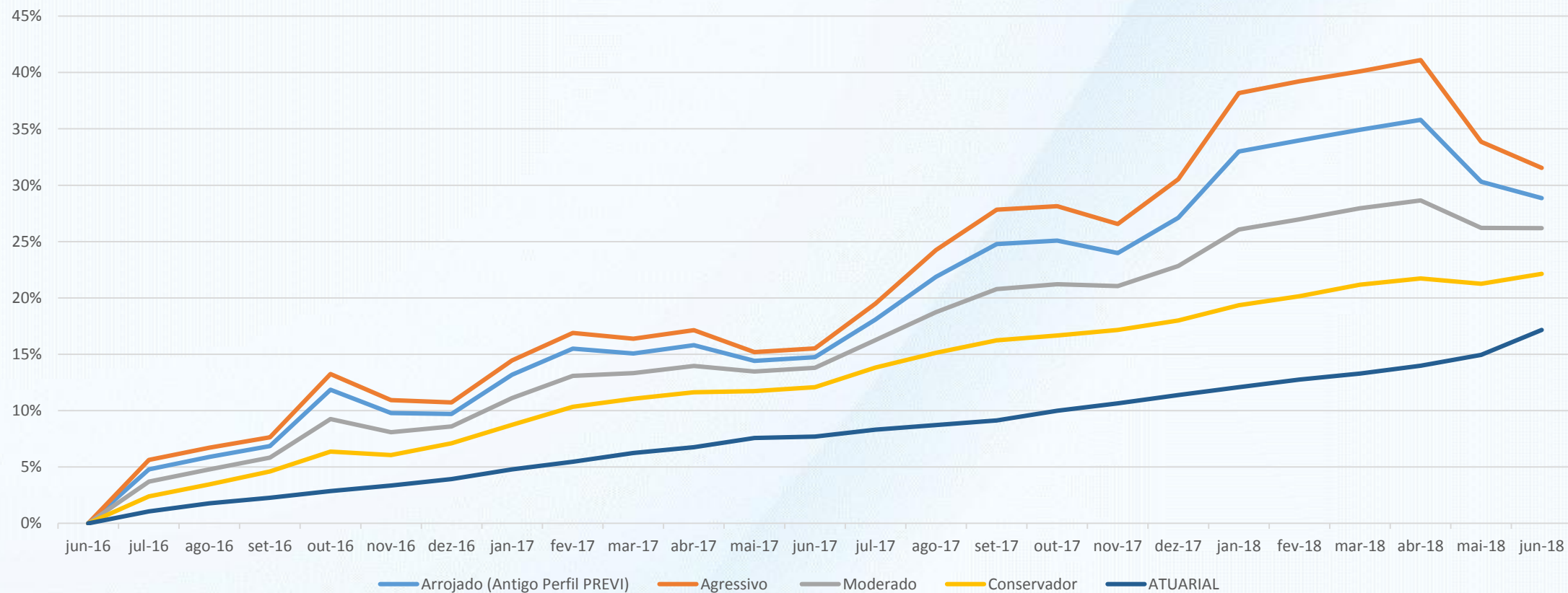
31,54%



Perfil de
3,47%
dos associados

Perfis de Investimentos

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses – Comparação entre os Perfis



Jun/16

Jun/18



[Fale Conosco](#)



0800 729 0505



[Canal Web](#)

OUVIR
SUA VOZ.

0800 729 0303