

Boletim de

DESEMPENHO

Previ Futuro - Mai / 2020



+



=



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:

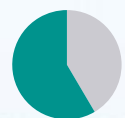
INPC
+
4,62% a.a.

Distribuição da Carteira de Investimentos - Mai / 2020

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas

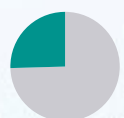


58,48%

Renda Variável



Investimentos em ações



25,45%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples



11,06%

Investimentos Imobiliários



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

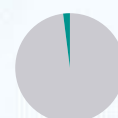


3,68%

Investimentos Estruturados



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

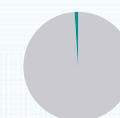


1,16%

Investimentos no Exterior



Aplicar ativos em países estrangeiros para obtenção de rentabilidade



0,18%

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 2020:
1,96%

Distribuição da Carteira de Investimentos – Mai / 2020

Rentabilidade 2020: **-7,37%** Valor de Mercado (mil) Mai / 2020: **18.366.650** ●

Renda Fixa



Rentabilidade 2020

-1,57%

Valor Mai-2020 (mil)
10.741.200



Renda Variável



Rentabilidade 2020

-23,55%

Valor Mai-2020 (mil)
4.673.795



Operações com Participantes



Rentabilidade 2020

4,24%

Valor Mai-2020 (mil)
2.030.596



Investimentos Imobiliários



Rentabilidade 2020

3,78%

Valor Mai-2020 (mil)
675.702



Investimentos Estruturados



Rentabilidade 2020

-2,05%

Valor Mai-2020 (mil)
212.497



Investimentos no Exterior



Rentabilidade 2020

13,71%

Valor Mai-2020 (mil)
32.859



● Abaixo da Meta

● Acima da Meta



Rentabilidade Acumulada

Meta Atuarial
acumulada:
1,96%

| | Valor (R\$ Mil) | Participação (%) | Rentabilidade de Maio% | Rentabilidade Acumulada em 2020 |
|-----------------------------|-------------------|------------------|------------------------|---------------------------------|
| Previ Futuro | 18.366.650 | 100% | 2,19% | -7,37% |
| Renda Fixa | 10.741.200 | 58,48% | 0,35% | -1,57% |
| Renda Variável | 4.673.795 | 25,45% | 8,90% | -23,55% |
| Ações | 4.608.495 | 98,60% | 8,95% | -23,44% |
| Fundos | 65.300 | 1,40% | 5,22% | -31,11% |
| Investimentos Estruturados | 212.497 | 1,16% | -2,94% | -2,05% |
| Investimentos Exterior | 32.859 | 0,18% | 2,94% | 13,71% |
| Investimentos Imobiliários | 675.702 | 3,68% | 0,16% | 3,78% |
| Operações com Participantes | 2.030.596 | 11,06% | 0,56% | 4,24% |

Resultado do Período (R\$ Milhões)

39,22

-90,05

Resultado Acumulado (R\$ Milhões)

-90,05



Renda Fixa

confira a relação completa dos ativos da carteira



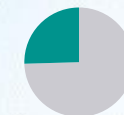
58,48%

| Carteiras | Valor de Mercado (R\$ Mil) | Participação na carteira | Rentabilidade | |
|---|-------------------------------|-----------------------------|---------------|-------------------|
| | | | Mai / 2020 | Acumulado 2020 |
| Renda Fixa | 10.741.200 | 58,48% | 0,35% | -1,57% |
| 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 | 3.443.612 | 32,06% | 0,01% | 3,00% |
| 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. | 4.814.547 | 44,82% | 0,29% | -4,97% |
| Caixa operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic. | 794.736 | 7,40% | 0,24% | 1,54% |
| 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. | 764.766 | 7,12% | 0,23% | 2,01% |
| Títulos privados de instit. não financeiras títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias. | 788.799 | 7,34% | 2,04% | -0,87% |
| Fundos de Investimentos RF | 134.740 | 1,25% | 1,07% | 2,01% |



Renda Variável

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

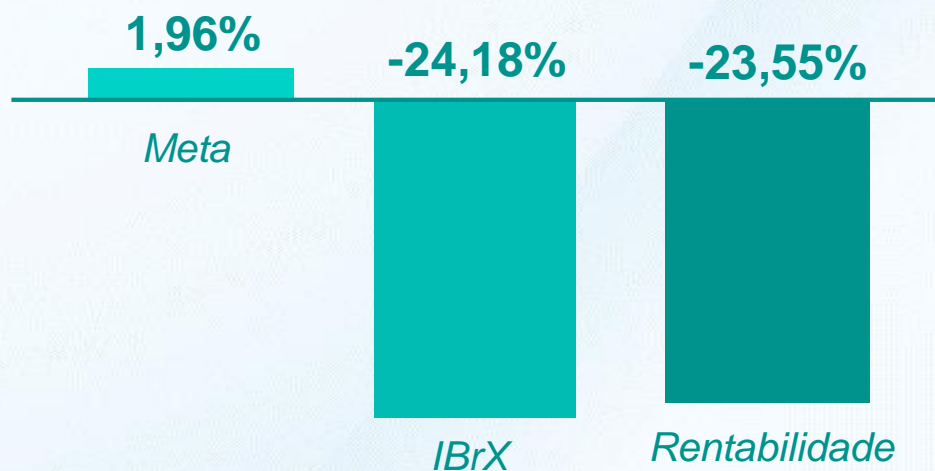


25,45%

| Carteiras | Valor de Mercado (R\$ Mil) | Participação | Rentabilidade | |
|----------------|-------------------------------|--------------|---------------|------------|
| | | | Mai / 2020 | Acum. 2020 |
| Renda Variável | 4.673.795 | 25,45% | 8,90% | -23,55% |
| Ações | 4.608.495 | 98,60% | 8,95% | -23,44% |
| Fundos | 65.300 | 1,40% | 5,22% | -31,11% |

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade

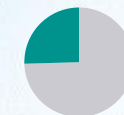




Renda Variável

confira a relação completa dos ativos da carteira

Valor de Mercado
(R\$ milhões)



25,45%

| 12 Maiores Ativos | Mai / 2020 | % na carteira | % patrimônio total |
|-------------------|------------|---------------|--------------------|
| VALE R DOCE ON | 485,68 | 10,39% | 2,64% |
| ITAUUNIBANCO PN | 311,25 | 6,66% | 1,69% |
| B3 ON | 259,69 | 5,56% | 1,41% |
| PETROBRAS PN | 248,87 | 5,32% | 1,35% |
| BRDESCO PN | 220,73 | 4,72% | 1,20% |
| PETROBRAS ON | 183,41 | 3,92% | 1,00% |
| MAGAZ LUIZA ON | 180,63 | 3,86% | 0,98% |
| LOJAS RENNER ON | 136,53 | 2,92% | 0,74% |
| BRASIL ON | 129,69 | 2,77% | 0,71% |
| LOCALIZA ON | 119,04 | 2,55% | 0,65% |
| JBS ON | 118,56 | 2,54% | 0,65% |
| RUMO S.A. ON | 115,64 | 2,47% | 0,63% |

Valor total da carteira
(R\$ milhões)

4.673,80

Valor dos 12 maiores ativos
(representa 53,7% da carteira)

2.509,70



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 | 2018 | 2019 | Acumulado 2020 |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------|------------------|
| VALE R DOCE ON | 94,85 | 33,22 | 14,94 |
| ITAUUNIBANCO PN | 99,33 | 52,95 | -153,09 |
| BRDESCO PN | 62,01 | 51,61 | -137,08 |
| PETROBRAS PN | 76,13 | 86,32 | -79,80 |
| AMBEV S/A ON | -46,23 | 29,98 | -45,56 |
| PETROBRAS ON | 54,53 | 46,22 | -63,67 |
| B3 ON | 21,55 | 81,28 | 30,51 |
| ITAUSA PN | 29,61 | 33,80 | -50,32 |
| BRASIL ON | 48,23 | 29,85 | -72,73 |
| LOJAS RENNER ON | 13,94 | 55,81 | -44,28 |
| ULTRAPAR ON | -25,23 | - | - |
| SUZANO PAPEL ON | 19,45 | 7,63 | -2,57 |
| Variação Anual (R\$ milhões) | ↑ 448,17 | ↑ 508,67 | ↓ -603,64 |



Operações com Participantes



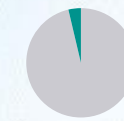
11,06%

| Carteiras | Valor de Mercado (R\$ Mil) | Participação | Rentabilidade | |
|-------------------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | | | Mai / 2020 | Acum. 2020 |
| Empréstimos e Financiamentos | 2.030.596 | 11,06% | 0,56% | 4,24% |
| Empréstimos Simples | 1.728.203 | 85,11% | 0,56% | 4,23% |
| Financiamentos | 302.393 | 14,89% | 0,55% | 4,26% |



Investimentos Imobiliários

confira a relação completa dos ativos da carteira

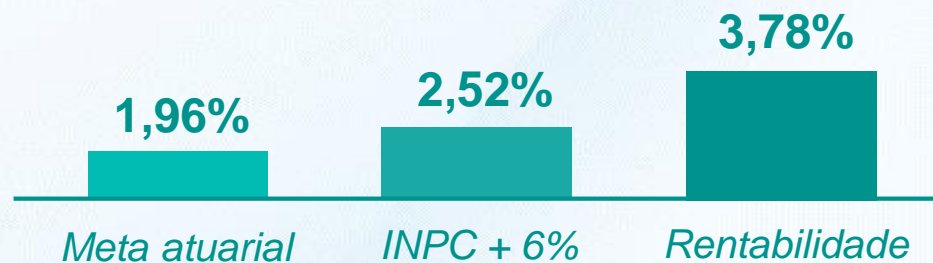


3,68%

| Valor de Mercado (R\$ Mil) | Rentabilidade | |
|----------------------------|---------------|----------------|
| | Mai / 2020 | Acumulado 2020 |
| 675.702 | 0,16% | 3,78% |

Eficiência Comparada

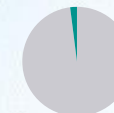
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos Estruturados

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

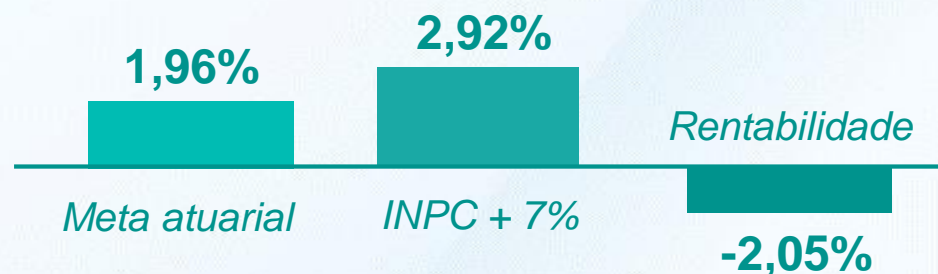


1,16%

| Valor de Mercado (R\$ Mil) | Rentabilidade | |
|----------------------------|---------------|----------------|
| | Mai / 2020 | Acumulado 2020 |
| 212.497 | -2,94% | -2,05% |

Eficiência Comparada

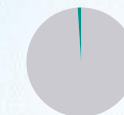
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

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

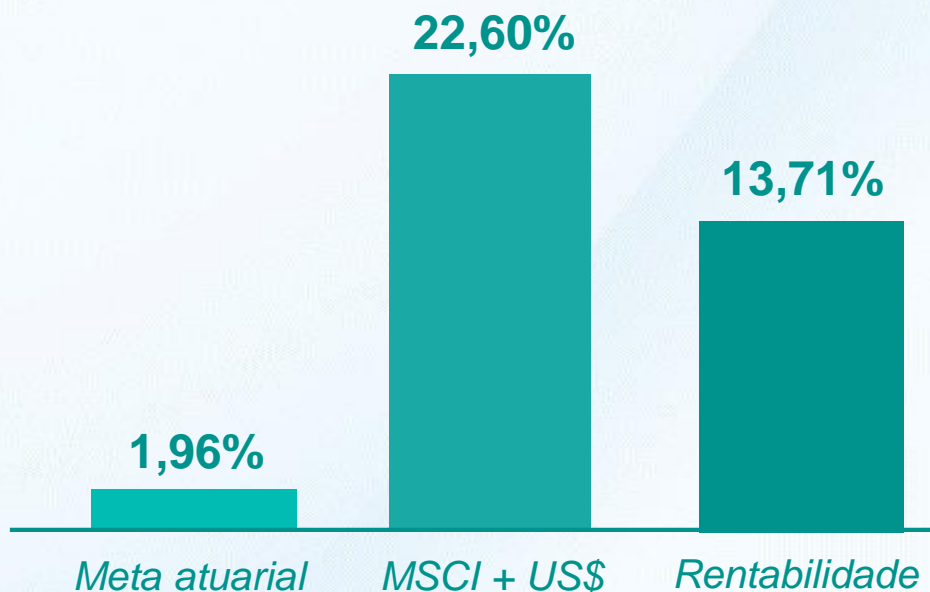


0,18%

| Valor de Mercado (R\$ Mil) | Rentabilidade | |
|----------------------------|---------------|----------------|
| | Mai / 2020 | Acumulado 2020 |
| 32.859 | 2,94% | 13,71% |

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 pode ser adequado para participantes próximos da aposentadoria.

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.

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.

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.

Ciclos de Vida



Alocação de 10% a 30% em Renda Variável*. É indicado para quem pretende se aposentar de 2026 a 2035. Nos perfis Ciclo de Vida, os investimentos em renda variável serão reduzidos ao longo dos anos, ou seja, substituídos por investimentos de menor risco até chegar ao nível compatível com o período esperado para sua aposentadoria.



Alocação de 25% a 45% em Renda Variável*. É indicado para quem pretende se aposentar de 2036 a 2045. Nos perfis Ciclo de Vida, os investimentos em renda variável serão reduzidos ao longo dos anos, ou seja, substituídos por investimentos de menor risco até chegar ao nível compatível com o período esperado para sua aposentadoria.



Alocação de 40% a 60% em Renda Variável*. É indicado para quem pretende se aposentar de 2046 em diante. Nos perfis Ciclo de Vida, os investimentos em renda variável serão reduzidos ao longo dos anos, ou seja, substituídos por investimentos de menor risco até chegar ao nível compatível com o período esperado para sua aposentadoria.

* até dezembro/2020.

Perfis de Investimento

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

Conservador



Rentabilidade

Maio de 2020

0,35%

Acumulado 2020

-0,57%

Últimos 12 meses

6,90%

Últimos 24 meses

24,79%

Moderado



Rentabilidade

Maio de 2020

1,48%

Acumulado 2020

-3,85%

Últimos 12 meses

5,27%

Últimos 24 meses

24,47%

Arrojado



Rentabilidade

Maio de 2020

2,70%

Acumulado 2020

-8,61%

Últimos 12 meses

2,52%

Últimos 24 meses

23,68%

Agressivo



Rentabilidade

Maio de 2020

3,91%

Acumulado 2020

-12,61%

Últimos 12 meses

0,21%

Últimos 24 meses

23,19%

Ciclos de Vida



Rentabilidade

Maio de 2020

1,94%

Acumulado 2020

-5,70%



Rentabilidade

Maio de 2020

2,86%

Acumulado 2020

-8,66%



Rentabilidade

Maio de 2020

3,86%

Acumulado 2020

-10,83%

Meta INPC + 4,62% a.a.: Maio de 2020 **0,13%**; Acumulado 2020 **1,96%**; Últimos 12 meses **6,99%**; Últimos 24 meses **17,71%**



Perfil Conservador

0% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Maio de 2020

0,35%

Acumulado 2020

-0,57%

Últimos 12 meses

6,90%

Últimos 24 meses

24,79%



Perfil de
11,41%
dos associados



Perfil Moderado

0% a 20% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Maio de 2020
1,48%
Acumulado 2020
-3,85%
Últimos 12 meses
5,27%
Últimos 24 meses
24,47%



Perfil de
6,89%
dos associados



Perfil Arrojado

20% a 40% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Maio de 2020

2,70%

Acumulado 2020

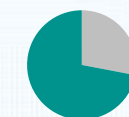
-8,61%

Últimos 12 meses

2,52%

Últimos 24 meses

23,68%



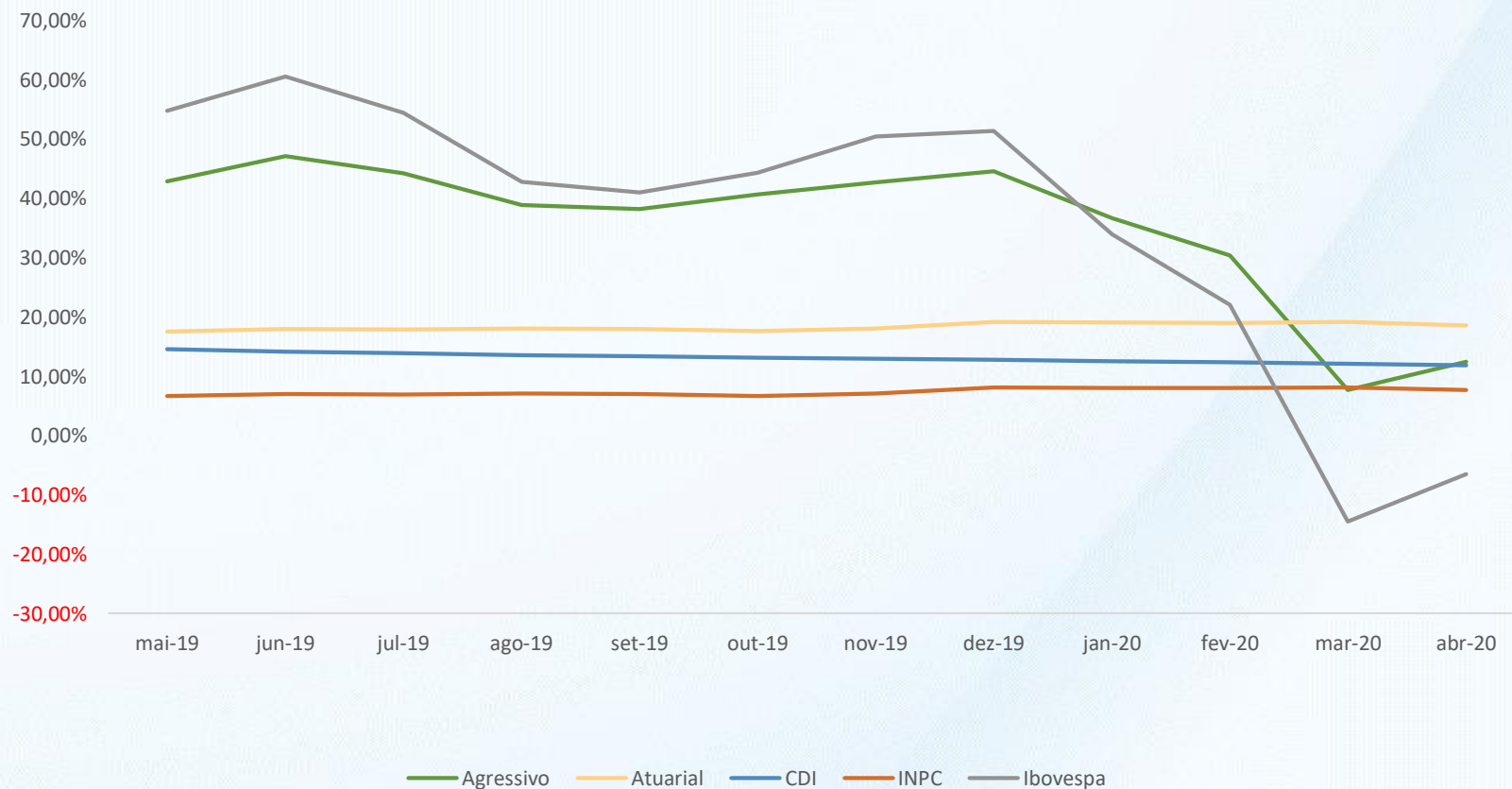
Perfil de
72,08%
dos associados



Perfil Agressivo

40% a 60% em RV

Rentabilidade Acumulada últimos 24 meses x Indicadores



Rentabilidade

Maio de 2020

3,91%

Acumulado 2020

-12,61%

Últimos 12 meses

0,21%

Últimos 24 meses

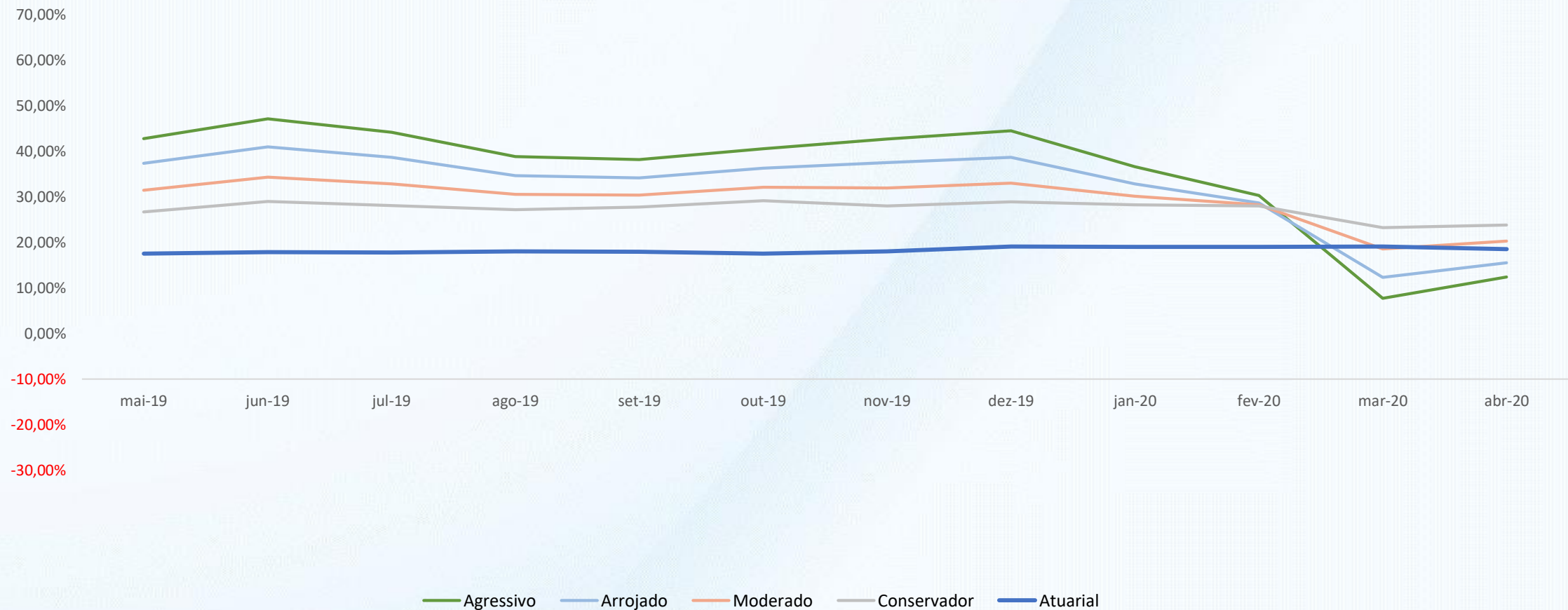
23,19%



Perfil de
8,13%
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