



FUNDO PETROLÍFERO DE TIMOR-LESTE

Relatório Mensal com Informação Financeira e de Desempenho do 31 Dezembro de 2017

A presente publicação tem por objectivo a apresentação mensal de dados relativos ao desempenho do Fundo Petrolífero.

Apesar de terem sido desenvolvidos todos os esforços no sentido de garantir a veracidade da informação aqui apresentada, a mesma não foi sujeita a qualquer auditoria independente, podendo vir a estar sujeita a alterações subsequentes que serão publicadas em relatórios posterior.

INFORMAÇÃO FINANCEIRO										
BALANÇO		US\$ 1,000	DECLARAÇÃO DE OUTROS GANHOS OU PERDAS E OUTROS RENDIMENTOS							
ATIVOS LÍQUIDOS			RENDIMENTO DO INVESTIMENTO							
Dinheiro e seus equivalentes		318.007	Juros de Recebidos		15.551					
Outros Recebimentos		31.422	Dividendo Recebidos		8.771					
Ativos financeiros avaliados ao preço de mercado com perda ou ganho		16.462.178	Rendimento do tipo "trust income"		1.109					
TOTAL DOS ATIVOS		16.811.607	Outros Rendimentos do Investimento		1					
MENOS: RESPONSABILIDADES			Ganhos/Perdas líquidas de activos financeiros e de passivos ao preço de Mercado		60.303					
Pagável por Títulos adquiridos		10.169	Ganhos/Perdas líquidas cambiais		32.918					
Contas a pagar		2.125	TOTAL DO RENDIMENTO DO INVESTIMENTO		118.654					
TOTAL RESPONSABILIDADES		12.294	DESPESAS							
			Taxas de gestão externa e de custódia		665					
TOTAL ATIVOS LÍQUIDOS		16.799.313	Custos de transacções		0					
CAPITAL			Custos de gestão internal BCTI		573					
Saldo de abertura em mês de anterior		16.867.686	Despesas co CCI		0					
Movimento Capital durante o mês		-184.972	Outras despesas		98					
Resultado líquido deste mês		116.598	TOTAL DAS DESPESAS		1.336					
TOTAL CAPITAL LÍQUIDOS		16.799.313	LUCRO ANTES DE IMPOSTOS		117.318					
			Impostos		720					
			LUCROS DO MÊS		116.598					
			Outros rendimentos		0					
			TOTAL RENDIMENTOS DURANTE O MÊS		116.598					
			RECEITAS E LEVANTAMENTOS MENSAIS							
			Art. 6.1 (a) da Lei do FP: Receitas dos Impostos		16.148					
			Art. 6.1 (b) da Lei do FP: Receitas de Royalties		22.681					
			Art. 6.1 (e) da Lei do FP: Outras Receitas		0					
			Art. 7.1 da Lei do FP: Transferência para o OGE		-223.800					
			TOTAL DE RECEITAS DURANTE O PERÍODO		-184.972					
SUMÁRIO DE DESEMPENHO										
		Valor de Mercado	Peso	Retorno/Rendimento do Fundo Petrolífero (%)						
				Mensal	Trimestral	AFAD	1 Ano	3 Anos	5 Anos	Desde o seu início
Total da Carteira		16.799.313	100,00%	0,69	2,17	10,36	10,36	4,72	4,81	4,36
Referência				0,63	2,04	10,23	10,23	4,65	4,71	4,32
Diferença				0,06	0,12	0,13	0,13	0,07	0,10	0,03
Títulos Internacionais de rendimento Fixo		9.735.476	57,95%	0,17	-0,16	2,70	2,70	1,42	1,00	2,64
Referência				0,14	-0,21	2,70	2,70	1,38	0,96	2,63
Diferença				0,02	0,05	0,00	0,00	0,03	0,03	0,01
BCTL Cash Management (TLCM)		197.910	1,18%	0,12	0,28	1,40	1,40	n.a	n.a	1,09
3 Months USD Libor				0,14	0,37	n.a	n.a	n.a	n.a	0,80
Diferença				-0,02	-0,08	n.a	n.a	n.a	n.a	0,28
Carteira de Títulos do BCTL 3-5 Anos		6.301.682	37,51%	0,00	-0,56	0,96	0,96	1,24	1,02	1,12
BoA Merrill Lynch 3-5 Years US Treasury Passivo				-0,03	-0,57	0,93	0,93	1,28	1,01	1,09
Diferença				0,03	0,01	0,04	0,04	-0,04	0,01	0,03
Carteira de Títulos do BIS		1.581.945	9,42%	0,12	-0,36	2,20	2,20	1,72	1,29	1,73
BoA Merrill Lynch 5-10 Years US Treasury Passivo Melhorado				0,11	-0,42	2,06	2,06	1,69	1,30	1,72
Diferença				0,01	0,06	0,14	0,14	0,03	-0,02	0,01
Carteira de Títulos do Alliance Bernstein		824.900	4,91%	0,82	1,48	10,51	10,51	1,15	n.a	-0,85
Barclays Global Treasury DM ex US Passivo Melhorado				0,87	1,42	10,61	10,61	1,21	n.a	-0,92
Diferença				-0,05	0,06	-0,10	-0,10	-0,06	n.a	0,07
Carteira de Títulos do Wellington Management		829.038	4,93%	0,88	1,41	10,52	10,52	1,13	n.a	0,80
Barclays Global Treasury DM ex US Passivo Melhorado				0,87	1,42	10,61	10,61	1,21	n.a	0,89
Diferença				0,00	-0,01	-0,08	-0,08	-0,08	n.a	-0,09
Ações Internacionais		7.063.837	42,05%	1,44	5,63	22,32	22,32	9,61	11,98	10,74
Referência				1,35	5,51	22,40	22,40	9,26	11,64	10,14
Diferença				0,08	0,13	-0,08	-0,08	0,35	0,34	0,60
Carteira de Ações do Schroders		899.017	5,35%	1,74	6,08	19,87	19,87	9,59	12,13	10,90
MSCI World Passivo Melhorado				1,35	5,51	22,40	22,40	9,26	11,64	10,14
Diferença				0,39	0,58	-2,53	-2,53	0,33	0,49	0,76
Carteira de Ações do SSgA		2.985.571	17,77%	1,29	5,52	22,72	22,72	9,65	11,97	12,08
MSCI World Passivo				1,27	5,47	22,47	22,47	9,27	11,64	11,70
Diferença				0,02	0,05	0,25	0,25	0,39	0,33	0,38
Carteira de Ações do Black Rock		2.989.167	17,79%	1,29	5,54	22,82	22,82	9,65	n.a	11,24
MSCI World Passivo				1,27	5,47	22,47	22,47	9,27	n.a	10,91
Diferença				0,02	0,07	0,36	0,36	0,39	n.a	0,33
Carteira de Ações do BCTL-EQ		190.082	1,13%	4,79	6,79	19,99	19,99	n.a	n.a	17,76
Australia MSCI Indice (MXAU) Passivo				4,75	6,79	19,93	19,93	n.a	n.a	17,74
Diferença				0,04	0,00	0,06	0,06	n.a	n.a	0,02

Note : 1. Os valores são apresentados em milhares excepto indicação em contrário
2. Os valores contabilísticos das receitas estão no base accrual
3. Números não pode resumir-se a arredondamentos.

BANCO CENTRAL DE TIMOR-LESTE

Avenida Bispo Medeiros
P.O.BOX 59 - DILI
TIMOR-LESTE

T: +670 331 371 2 / 4 / 5 / 8
F: +670 331 371 3 / 6 / 7
E: info(at)bancocentral.tl