



FUNDO PETROLÍFERO DE TIMOR-LESTE

Relatório Mensal com Informação Financeira e de Desempenho do 28 Fevereiro de 2018

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			DECLARAÇÃO DE OUTROS GANHOS OU PERDAS E OUTROS RENDIMENTOS									
BALANÇO	US\$ 1,000		RENDIMENTO DO INVESTIMENTO									
ACTIVOS LÍQUIDOS			RENDIMENTO DO INVESTIMENTO									
Dinheiro e seus equivalentes	699.761		Juros de Recebidos									
Outros Recebimentos	89.457		Dividendo Recebidos									
Activos financeiros avaliados ao preço de mercado com perda ou ganho	16.143.094		Rendimento do tipo "trust income"									
TOTAL DOS ACTIVOS	16.932.312		Outros Rendimentos do Investimento									
MENOS: RESPONSABILIDADES			Ganhos/Perdas líquidas de activos financeiros e de passivos ao preço de Mercado									
Pagável por Titulus adquiridos	66.164		Ganhos/Perdas líquidas cambiais									
Contas a pagar	2.157		TOTAL DO RENDIMENTO DO INVESTIMENTO									
TOTAL RESPONSABILIDADES	68.321		DESPESAS									
TOTAL ACTIVOS LÍQUIDOS	16.863.991		Taxas de gestão externa e de custódia									
CAPITAL			Custos de transacções									
Saldo de abertura em mês de anterior	17.157.920		Custos de gestão internal BCTI									
Movimento Capital durante o mês	42.701		Despesas co CCI									
Resultado líquido deste mês	-336.630		Outras despesas									
TOTAL CAPITAL LÍQUIDOS	16.863.991		TOTAL DAS DESPESAS									
			LUCRO ANTES DE IMPOSTOS									
			Impostos									
			LUCROS DO MÊS									
			Outros rendimentos									
			TOTAL RENDIMENTOS DURANTE O MÊS									
			RECEITAS E LEVANTAMENTOS MENSIAIS									
			Art. 6.1 (a) da Lei do FP: Receitas dos Impostos									
			Art. 6.1 (b) da Lei do FP: Receitas de Royalties									
			Art. 6.1 (e) da Lei do FP: Outras Receitas									
			Art. 7.1 da Lei do FP: Transferência para o OGE									
			TOTAL DE RECEITAS DURANTE O PERÍODO									
SUMÁRIO DE DESEMPENHO			Retorno/Rendimento do Fundo Petrolífero (%)									
	Valor de Mercado	Peso	Mensal	Trimestral	AFAD	1 Ano	3 Anos	5 Anos	Desde o seu início			
Total da Carteira	16.863.991	100,00%	-1,92	0,95	-0,05	7,46	4,08	4,50	4,28			
Referência			-2,02	0,37	-0,25	7,20	3,93	4,38	4,24			
Diferença			0,10	0,27	0,21	0,26	0,15	0,12	0,05			
Títulos Internacionais de rendimento Fixo	10.348.759	61,37%	-0,59	-0,82	-0,99	0,91	0,94	0,79	2,52			
Referência			-0,64	-0,96	-1,10	0,91	0,88	0,73	2,50			
Diferença			0,04	0,13	0,11	0,14	0,07	0,05	0,02			
BCTL Cash Management (TLCM)	638.951	3,79%	0,15	0,38	0,26	1,54	n.a	n.a	1,13			
3 Months USD Libor			0,14	0,42	0,29	n.a	n.a	n.a	1,09			
Diferença			0,01	-0,05	-0,03	n.a	n.a	n.a	0,04			
Carteira de Títulos do BCTL 3-5 Anos	6.419.102	38,06%	-0,23	-1,16	-1,16	-0,61	0,58	0,75	0,90			
BoA Merrill Lynch 3-5 Years US Treasury Passivo			-0,25	-1,24	-1,21	-0,72	0,60	0,74	0,86			
Diferença			0,02	0,08	0,05	0,11	-0,03	0,02	0,04			
Carteira de Títulos do BIS	1.627.292	9,65%	-0,66	-2,31	-2,43	-1,11	0,45	0,83	1,29			
BoA Merrill Lynch 5-10 Years US Treasury Passivo Melhorado			-0,66	-2,34	-2,45	-1,24	0,40	0,84	1,27			
Diferença			0,00	0,03	0,02	0,12	0,04	-0,02	0,01			
Carteira de Títulos do Alliance Bernstein	830.090	4,92%	-2,11	1,59	0,75	9,05	2,19	n.a	-0,61			
Barclays Global Treasury DM ex US Passivo Melhorado			-2,15	1,59	0,71	8,97	2,18	n.a	-0,69			
Diferença			0,04	0,00	0,05	0,07	0,01	n.a	0,08			
Carteira de Títulos do Wellington Management	833.324	4,94%	-2,17	1,57	0,69	8,91	2,10	n.a	0,97			
Barclays Global Treasury DM ex US Passivo Melhorado			-2,15	1,59	0,71	8,97	2,18	n.a	1,06			
Diferença			-0,02	-0,02	-0,02	-0,06	-0,08	n.a	-0,09			
Ações Internacionais	6.515.233	38,63%	-4,02	2,38	0,93	17,31	8,54	11,04	10,62			
Referência			-4,14	2,28	0,92	17,36	8,19	10,70	10,04			
Diferença			0,13	0,10	0,01	-0,04	0,35	0,34	0,59			
Carteira de Ações do Schroders	813.397	4,82%	-3,53	2,68	0,93	15,30	8,56	11,14	10,78			
MSCI World Passivo Melhorado			-4,14	2,28	0,92	17,36	8,19	10,70	10,04			
Diferença			0,61	0,40	0,01	-2,06	0,36	0,44	0,74			
Carteira de Ações do SS&A	2.755.738	16,34%	-4,10	2,26	0,96	17,78	8,58	11,04	11,91			
MSCI World Passivo			-4,16	2,24	0,96	17,56	8,21	10,71	11,54			
Diferença			0,06	0,02	0,00	0,22	0,37	0,33	0,37			
Carteira de Ações do Black Rock	2.757.224	16,35%	-4,11	2,30	1,00	17,90	8,60	11,04	11,07			
MSCI World Passivo			-4,16	2,24	0,96	17,56	8,21	10,71	10,74			
Diferença			0,05	0,06	0,04	0,34	0,39	0,33	0,33			
Carteira de Ações do BCTL-EQ	188.874	1,12%	-3,46	4,13	-0,63	10,22	n.a	n.a	15,41			
Australia MSCI Indíce (MXAU) Passivo			-3,47	4,10	-0,62	10,18	n.a	n.a	15,40			
Diferença			0,01	0,03	-0,01	0,04	n.a	n.a	0,01			

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