

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/04/2020

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	163.596.472,70	72,94%				1,58%	1,37%	3,35%	1,85%	9,86%	18,59%	30,75%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,17%	1,34%	4,64%	1,98%	7,81%	19,12%	27,39%
Renda Fixa	163.596.472,70	72,94%			1,73%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	43.554.194,79	19,42%		100%	5,83%	0,59%	-1,10%	0,81%	-0,05%	4,91%	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21.715.827,35	9,68%	BB	4,22%	0,01%	0,26%	0,84%	1,93%	1,20%	4,93%	11,33%	20,16%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	57.917.159,32	25,82%	BRADESCO	100%	0,58%	0,44%	1,04%	2,07%	1,40%	5,33%	11,68%	20,80%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	40.244.309,46	17,94%	BRADESCO	0,50%	0,01%	0,26%	0,86%	1,96%	1,22%	4,99%	11,45%	20,42%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	85.208,37	0,04%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,56%	1,75%	3,80%	2,44%	8,90%	19,83%	34,06%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	16.946,12	0,01%	BRPP	3,01%		0,56%	1,75%	3,80%	2,44%	8,90%	19,83%	34,06%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	62.827,29	0,03%	VILA RICA	1,88%		0,56%	1,75%	3,80%	2,44%	8,90%	19,83%	34,06%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,17%	1,34%	4,64%	1,98%	7,81%	19,12%	27,39%
Renda Variável	40.982.827,37	18,27%				10,97%	-30,49%	-24,64%	-30,45%	-14,13%	-4,96%	16,90%
Benchmark:	IBOVESPA					10,25%	-29,23%	-24,92%	-30,39%	-16,45%	-6,51%	23,09%
Renda Variável	40.982.827,37	18,27%			35,87%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	5.003.969,55	2,23%		100%	51,23%	17,10%	-26,73%	-	-30,92%	-	-	-
FIOPREV FIA	35.978.857,82	16,04%	QUELUZ	100%	34,02%	10,16%	-30,98%	-24,05%	-30,37%	-12,32%	-2,94%	21,76%
Benchmark:	IBOVESPA					10,25%	-29,23%	-24,92%	-30,39%	-16,45%	-6,51%	23,09%
Imobiliário **	19.146.756,85	8,54%				0,46%	0,21%	1,94%	1,75%	9,48%	21,38%	13,84%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,17%	1,34%	4,64%	1,98%	7,81%	19,12%	27,39%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11.796.312,17	5,26%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	11.796.312,17	5,26%		100%	5,67%	0,50%	-0,06%	-	2,04%	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,28%	0,92%	2,07%	1,30%	5,20%	11,88%	20,96%
Imóveis	5.403.680,37	2,41%				0,38%	1,13%	1,98%				
FII	1.946.764,31	0,87%										
VECTOR LAJES FII	1.946.764,31	0,87%	QUELUZ	12,20%		0,42%	-19,13%	-33,61%	-0,12%	-32,84%	-28,20%	-23,52%
Benchmark:	IFIX					4,39%	-15,39%	-6,75%	-18,58%	3,79%	11,40%	27,94%
Operações com Participantes **	514.957,89	0,23%				-2,61%	-4,00%	-5,50%	-7,23%	-5,05%	142,35%	160,93%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,17%	1,34%	4,64%	1,98%	7,81%	19,12%	27,39%
Total	224.299.214,98	100%				8,06%	3,06%	-6,44%	-3,26%	-6,02%	4,52%	14,04%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					0,10%	1,11%	4,15%	1,66%	6,78%	16,87%	23,80%

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/03/2020

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

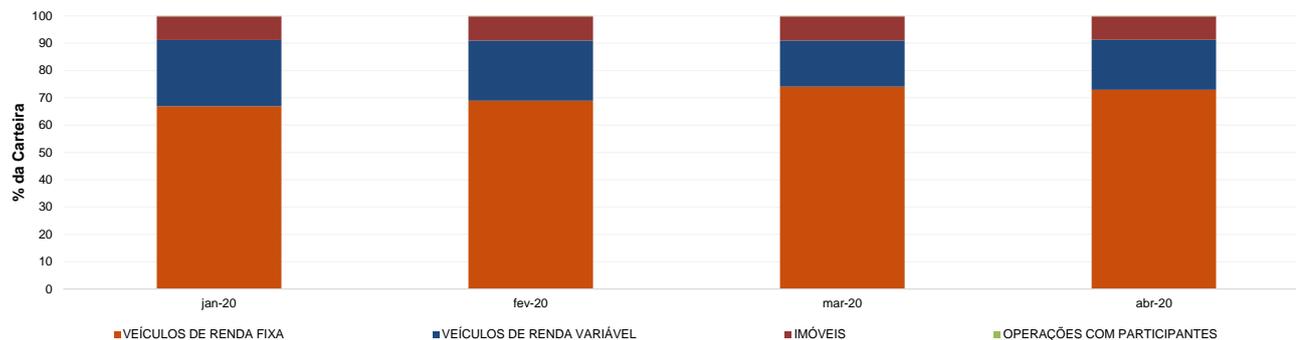
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

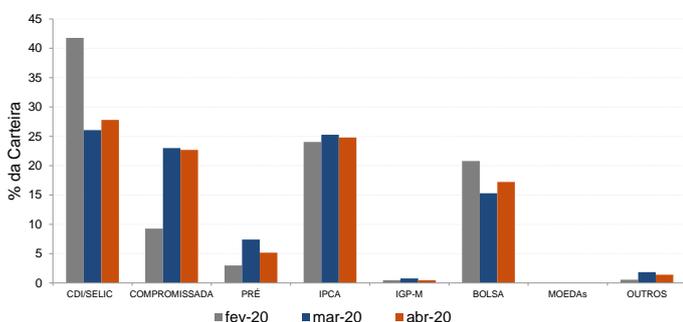
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

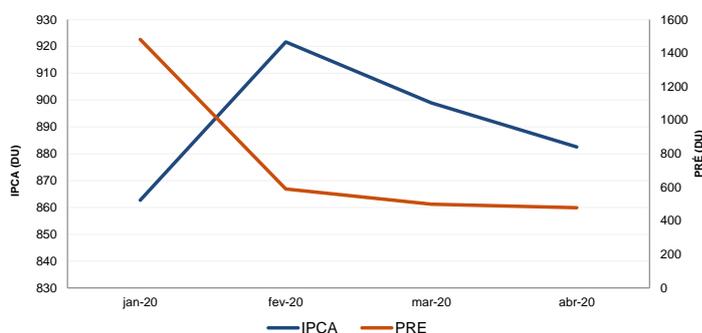
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.356,11	16,51	5.217,42	15,78
VALE3	Mineração	5.217,67	13,56	5.026,92	15,20
ITUB4	Intermediários Financeiros	2.950,99	7,67	2.276,67	6,89
BBDC4	Intermediários Financeiros	2.142,31	5,57	2.112,31	6,39
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.040,10	5,30	1.762,69	5,33
BTOW3	Comércio	1.992,40	5,18	1.473,60	4,46
MGLU3	Comércio	1.823,99	4,74	970,85	2,94
JBSS3	Alimentos Processados	1.490,00	3,87	1.271,25	3,84
GOAU4	Siderurgia e Metalurgia	1.354,97	3,52	1.223,42	3,70
VVAR3	Comércio	1.131,89	2,94	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

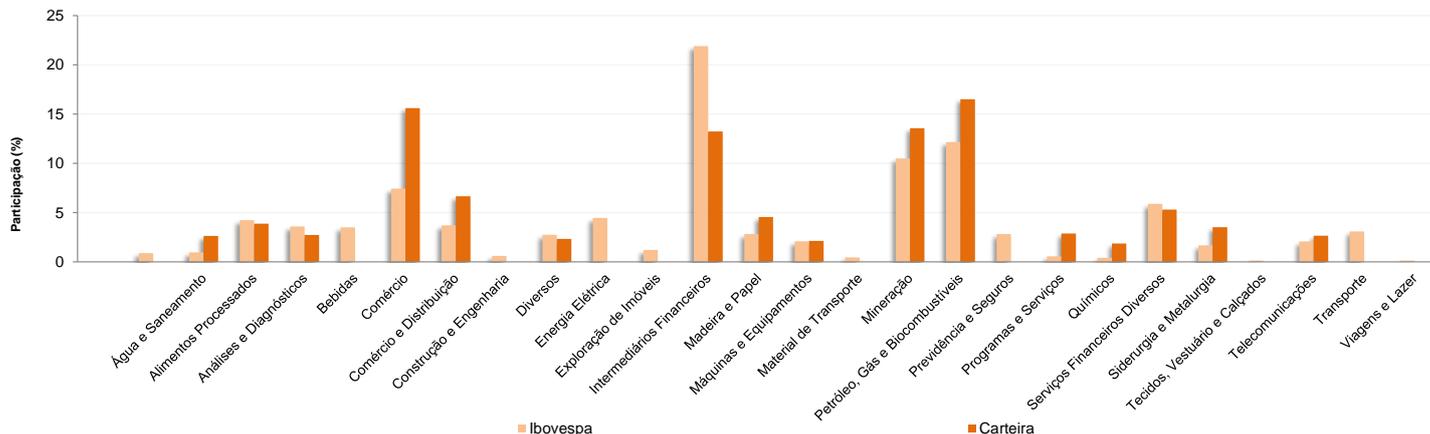
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	6.356,11	16,51	0,01	1
VALE3	5.217,67	13,56	0,00	1
ITUB4	2.950,99	7,67	0,00	1
BBDC4	2.142,31	5,57	0,00	1
B3SA3	2.040,10	5,30	0,00	1
BTOW3	1.992,40	5,18	0,01	1
MGLU3	1.823,99	4,74	0,01	1
JBSS3	1.490,00	3,87	0,00	1
GOAU4	1.354,97	3,52	0,04	1
VVAR3	1.131,89	2,94	0,01	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Análises de Contrapartes

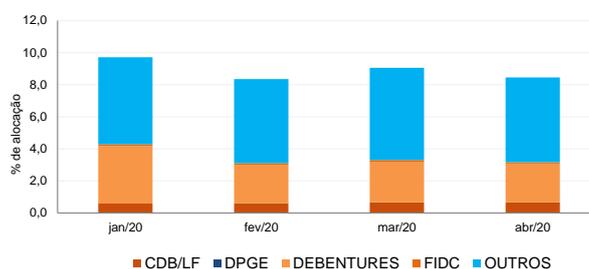
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10.550,10	4,84	Sem Faixa
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	6.356,11	2,92	Faixa 2
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5.297,92	2,43	Faixa 4
VALE SA	5.217,67	2,39	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.579,96	1,64	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.950,99	1,35	Faixa 3
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.040,10	0,94	Faixa 1
B2W CIA DIGITAL	1.992,40	0,91	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	1.823,99	0,84	Faixa 1
JBS SA	1.490,00	0,68	Faixa 2

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/04/2020

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta.

É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-09-01	01-set-20	45.437	0,02%	Selic	22-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.316	0,00%	Selic	01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.264	0,00%	Selic	17-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.106	0,00%	Selic	01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	684	0,00%	Selic	24-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	684	0,00%	Selic	13-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	421	0,00%	Selic	20-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	421	0,00%	Selic	07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	369	0,00%	Selic	22-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	369	0,00%	Selic	07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	316	0,00%	Selic	07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	263	0,00%	Selic	01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	211	0,00%	Selic	24-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	211	0,00%	Selic	07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	158	0,00%	Selic	02-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.632.258	1,21%	Selic	24-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	157.935	0,07%	Selic	23-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	85.812	0,04%	Selic	13-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	42.116	0,02%	Selic	17-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	789.576	0,36%	Selic	27-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	16.836	0,01%	Selic	17-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	28.932	0,01%	Selic	17-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	420.427	0,19%	Selic	03-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

