

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/06/2020

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	165.718.533,19	71,11%				0,50%	3,07%	3,34%	3,34%	8,98%	20,49%	31,49%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,72%	1,05%	2,87%	2,87%	7,69%	16,97%	27,32%	
Renda Fixa	165.718.533,19	71,11%				0,98%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	45.386.870,47	19,48%		100%	3,49%	1,26%	4,82%	4,16%	4,16%	-	-	-	
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21.805.633,02	9,36%	BB	4,30%	0,01%	0,19%	0,67%	1,62%	1,62%	4,34%	10,69%	18,59%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	58.263.586,73	25,00%	BRADESCO	100%	0,10%	0,23%	1,04%	2,01%	2,01%	4,78%	11,51%	19,49%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	40.084.201,90	17,20%	BRADESCO	0,49%	0,02%	0,20%	0,69%	1,65%	1,65%	4,41%	10,82%	18,80%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	83.795,93	0,04%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,50%	1,58%	3,49%	3,49%	8,30%	19,12%	32,32%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	15.587,19	0,01%	BRPP	3,01%		0,50%	1,58%	3,49%	3,49%	8,30%	19,12%	32,32%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	78.857,93	0,03%	VILA RICA	1,88%		0,50%	1,58%	3,49%	3,49%	8,30%	19,12%	32,32%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,72%	1,05%	2,87%	2,87%	7,69%	16,97%	27,32%	
Renda Variável	47.830.011,32	20,52%				7,63%	29,51%	-18,83%	-18,83%	-6,81%	27,08%	43,81%	
Benchmark:	IBOVESPA					8,76%	30,18%	-17,80%	-17,80%	-5,85%	30,64%	51,12%	
Renda Variável	47.830.011,32	20,52%				25,81%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.084.568,65	2,61%		100%	25,93%	5,76%	42,39%	-16,00%	-16,00%	-	-	-	
FIOPREV FIA	41.745.442,67	17,91%	QUELUZ	100%	26,03%	7,90%	27,82%	-19,21%	-19,21%	-6,13%	27,79%	44,41%	
Benchmark:	IBOVESPA					8,76%	30,18%	-17,80%	-17,80%	-5,85%	30,64%	51,12%	
Imobiliário **	18.953.649,06	8,13%				-0,35%	1,28%	2,59%	2,59%	6,18%	23,24%	13,44%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,72%	1,05%	2,87%	2,87%	7,69%	16,97%	27,32%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11.573.273,43	4,97%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	11.573.273,43	4,97%		100%	3,72%	-0,78%	1,13%	2,68%	2,68%	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%	
Imóveis	5.390.770,85	2,31%				0,40%	1,15%	2,77%	2,77%				
FII	1.989.604,78	0,85%											
VECTOR LAJES FII	1.989.604,78	0,85%	QUELUZ	12,20%		0,29%	2,63%	2,08%	2,08%	-33,99%	-26,08%	-22,28%	
Benchmark:	IFIX					5,59%	12,52%	-12,24%	-12,24%	6,86%	32,05%	35,31%	
Operações com Participantes **	475.227,56	0,20%				-2,24%	-6,13%	-11,53%	-11,53%	-6,66%	136,04%	159,12%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,72%	1,05%	2,87%	2,87%	7,69%	16,97%	27,32%	
Total	233.033.333,53	100%				6,20%	1,81%	7,38%	-2,08%	-2,08%	5,14%	22,24%	33,53%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					0,64%	0,82%	2,39%	2,39%	6,66%	14,77%	23,75%	

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 29/05/2020

* 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.

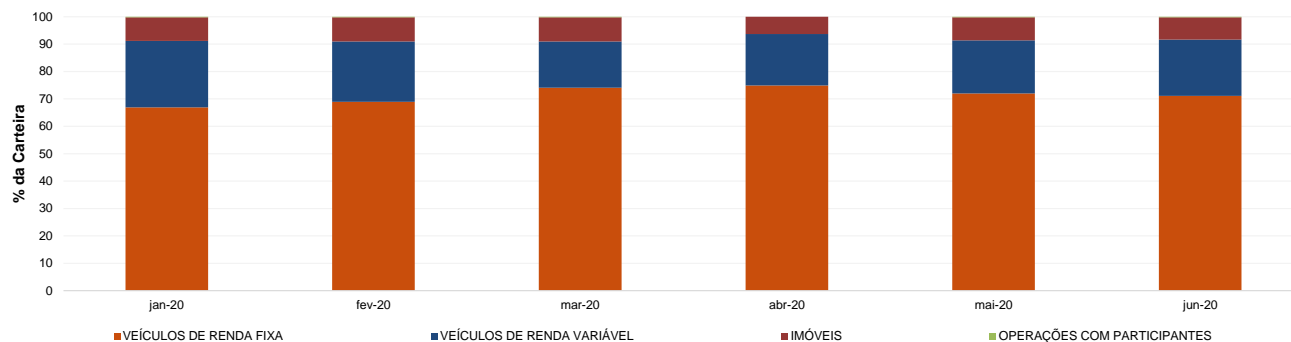
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

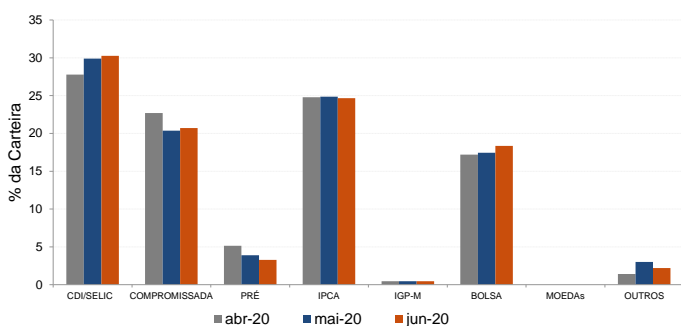
Distribuição da Carteira

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.

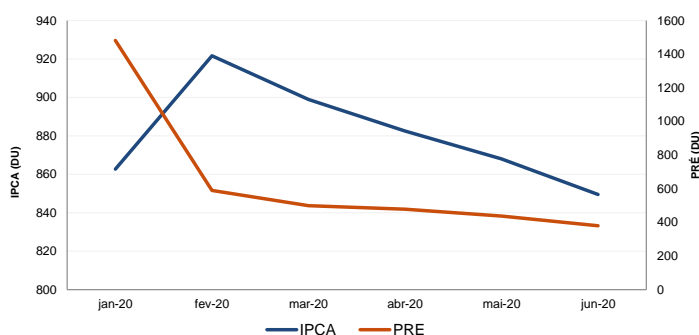
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	6.297,15	14,80	6.164,43	15,53
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.263,27	14,72	7.089,28	17,86
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.705,52	8,71	3.354,62	8,45
MGLU3	Comércio	1.984,71	4,66	1.782,50	4,49
BTOW3	Comércio	1.520,11	3,57	2.391,28	6,02
WEGE3	Máquinas e Equipamentos	1.493,00	3,51	853,33	2,15
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.470,90	3,46	2.628,24	6,62
ELET3	Energia Elétrica	1.444,60	3,39	0,00	
CNTO3	Comércio	1.413,07	3,32	1.234,77	3,11
UGPA3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.409,75	3,31	760,13	1,92

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

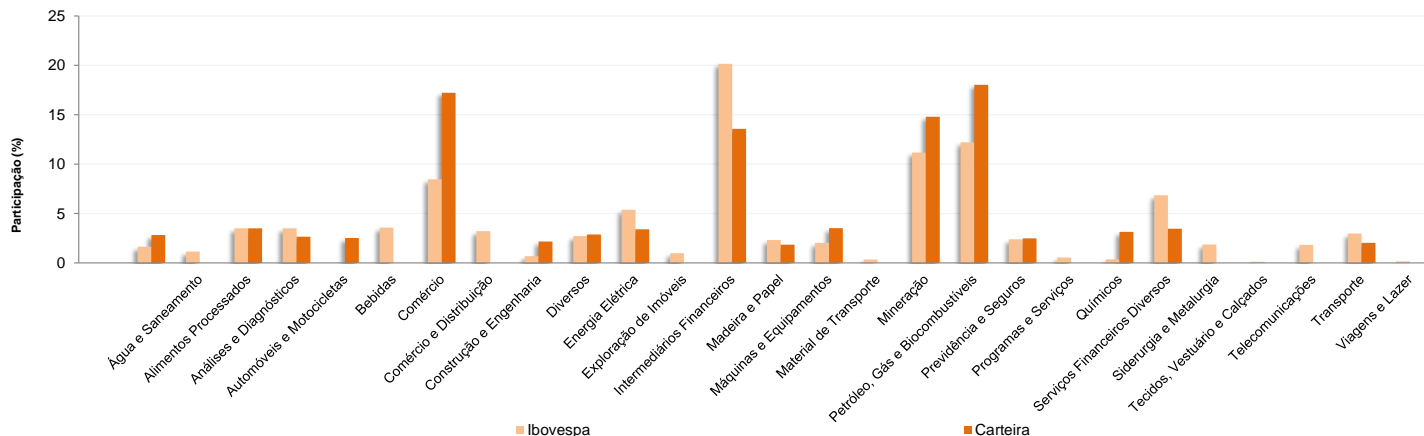
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	6.297,15	14,80	0,00	1
PETR4	6.263,27	14,72	0,01	1
ITUB4	3.705,52	8,71	0,00	1
MGLU3	1.984,71	4,66	0,00	1
BTOW3	1.520,11	3,57	0,01	1
WEGE3	1.493,00	3,51	0,00	1
B3SA3	1.470,90	3,46	0,00	1
ELET3	1.444,60	3,39	0,01	1
CNTO3	1.413,07	3,32	0,05	1
UGPA3	1.409,75	3,31	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

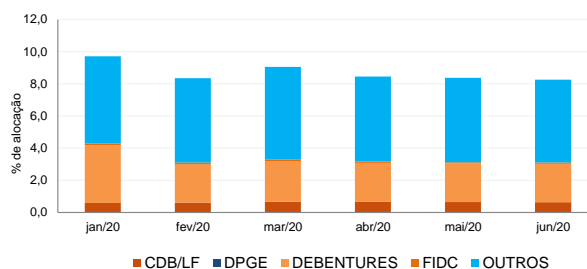
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10.678,74	4,70	Sem Faixa
VALE SA	6.297,15	2,77	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	6.263,27	2,76	Faixa 2
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5.428,37	2,39	Faixa 4
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.705,52	1,63	Faixa 3
MAGAZINE LUIZA SA	1.984,71	0,87	Faixa 1
B2W CIA DIGITAL	1.520,11	0,67	Faixa 2
WEG SA	1.493,00	0,66	Sem Faixa
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.470,90	0,65	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1.449,42	0,64	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: 30/06/2020

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	1.603	0,00%	Selic	10-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.241	0,00%	Selic	01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.189	0,00%	Selic	15-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.086	0,00%	Selic	01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	724	0,00%	Selic	22-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	672	0,00%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	517	0,00%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	517	0,00%	Selic	09-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	362	0,00%	Selic	10-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	362	0,00%	Selic	29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	310	0,00%	Selic	18-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	259	0,00%	Selic	01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	259	0,00%	Selic	08-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	259	0,00%	Selic	09-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	207	0,00%	Selic	09-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	207	0,00%	Selic	18-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	207	0,00%	Selic	29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	155	0,00%	Selic	01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	155	0,00%	Selic	24-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	155	0,00%	Selic	29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	103	0,00%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	517.051	0,23%	Selic	24-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	232.673	0,10%	Selic	02-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	93.069	0,04%	Selic	02-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	178.962	0,08%	Selic	02-jun-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	103.285	0,05%	Selic	02-jun-20	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	283.899	0,12%	Selic	02-jun-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

