

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/08/2020

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	167.165.433,82	70,23%				0,51%	1,68%	3,65%	4,56%	9,11%	20,46%	29,13%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,78%	2,43%	3,41%	4,62%	8,29%	17,60%	28,16%	
Renda Fixa	167.165.433,82	70,23%			0,57%								
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	45.137.543,80	18,96%		100%	2,04%	0,51%	2,45%	3,22%	5,38%	7,55%	-	-	
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21.874.027,02	9,19%	BB	4,84%	0,01%	0,14%	0,51%	1,31%	1,94%	3,60%	9,86%	17,11%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59.251.639,96	24,89%	BRADESCO	100%	0,09%	0,10%	0,56%	1,65%	2,34%	4,05%	10,82%	17,92%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	40.013.893,87	16,81%	BRADESCO	0,53%	0,01%	0,15%	0,52%	1,34%	1,98%	3,66%	9,99%	17,31%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	83.530,64	0,04%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,45%	1,47%	3,22%	4,48%	7,51%	18,21%	30,69%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	23.223,55	0,01%	BRPP	3,01%		0,45%	1,47%	3,22%	4,48%	7,51%	18,21%	30,69%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	781.574,98	0,33%	VILA RICA	1,88%		0,45%	1,47%	3,22%	4,48%	7,51%	18,21%	30,69%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,78%	2,43%	3,41%	4,62%	8,29%	17,60%	28,16%	
Renda Variável	51.482.914,77	21,63%				-0,96%	15,85%	-1,44%	-12,63%	0,86%	33,96%	42,47%	
Benchmark:	IBOVESPA					-3,44%	13,69%	-4,61%	-14,07%	-1,75%	29,59%	40,28%	
Renda Variável	51.482.914,77	21,63%			13,62%								
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.314.985,51	2,65%		100%	11,25%	-1,53%	9,76%	2,63%	-12,82%	-	-	-	
FIOPREV FIA	45.167.929,26	18,98%	QUELUZ	100%	14,04%	-0,88%	16,75%	-1,98%	-12,59%	0,57%	37,27%	42,34%	
Benchmark:	IBOVESPA					-3,44%	13,69%	-4,61%	-14,07%	-1,75%	29,59%	40,28%	
Imobiliário	18.945.973,52	7,96%				-0,20%	1,71%	2,46%	4,70%	7,55%	23,34%	29,27%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,78%	2,43%	3,41%	4,62%	8,29%	17,60%	28,16%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11.550.500,14	4,85%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARIA	11.550.500,14	4,85%		100%	2,29%	-0,56%	1,67%	2,42%	5,22%	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,16%	0,57%	1,44%	2,12%	3,88%	10,40%	17,95%	
Imóveis	5.371.406,56	2,26%				0,38%	1,16%	2,30%	3,55%				
FII	2.024.066,82	0,85%											
VECTOR LAJES FII	2.024.066,82	0,85%	QUELUZ	12,20%		0,32%	2,03%	-15,18%	3,85%	-29,29%	-26,12%	-22,27%	
Benchmark:	IFIX					1,79%	4,68%	-6,13%	-12,99%	4,72%	30,04%	33,50%	
Operações com Participantes	450.603,82	0,19%				3,46%	-0,52%	-6,85%	-9,97%	-9,38%	139,33%	152,50%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,78%	2,43%	3,41%	4,62%	8,29%	17,60%	28,16%	
Total	238.033.991,17	100%				3,45%	0,14%	4,43%	2,47%	0,44%	4,01%	23,60%	32,26%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					0,70%	2,18%	2,91%	3,96%	7,26%	15,38%	24,57%	

* 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 EFPC.

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.

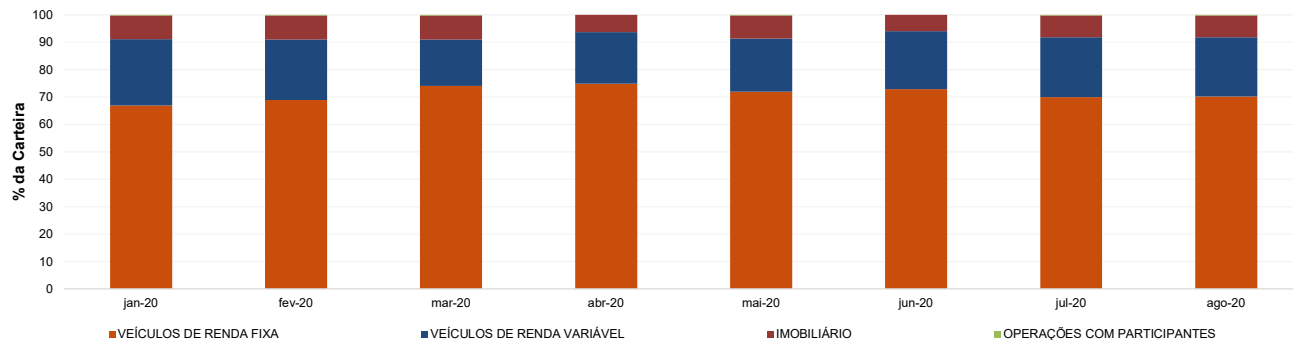
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

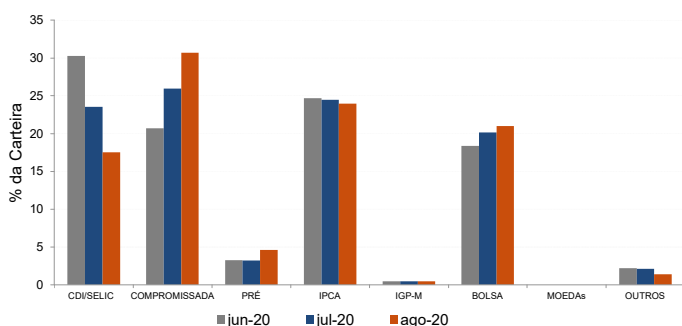
Distribuição da Carteira

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.

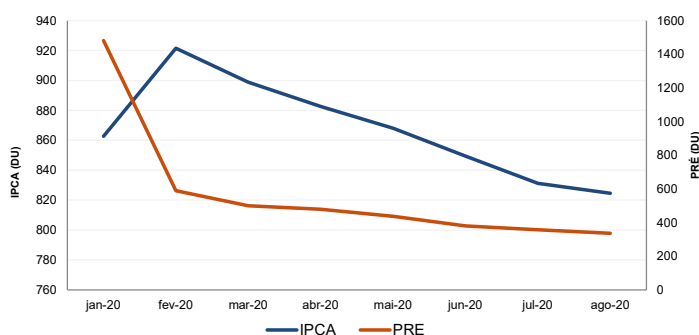
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	6.798,15	13,57	6.466,22	13,01
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5.392,36	10,76	7.309,11	14,71
BTOW3	Comércio	3.452,37	6,89	2.684,70	5,40
BBDC4	Intermediários Financeiros	3.086,11	6,16	0,00	
SUZB3	Madeira e Papel	2.635,50	5,26	0,00	
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.598,96	5,19	0,00	
QUAL3	Análises e Diagnósticos	2.308,64	4,61	2.069,20	4,16
MGLU3	Comércio	2.144,06	4,28	2.687,64	5,41
LAME4	Comércio	2.126,59	4,25	1.797,07	3,62
JSLG3	Transporte	2.097,07	4,19	1.910,10	3,84

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

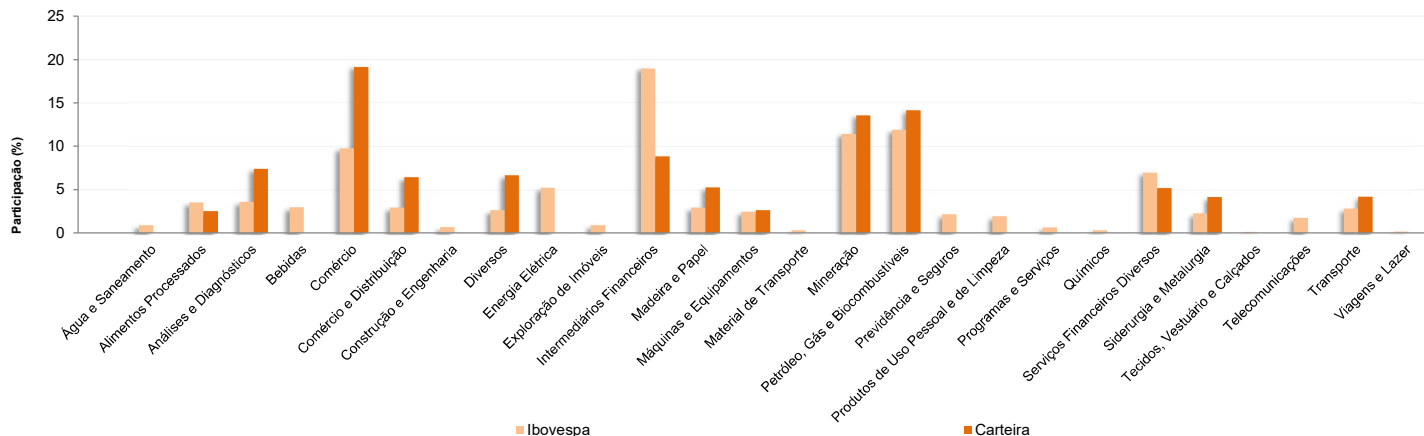
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	6.798,15	13,57	0,00	1
PETRA4	5.392,36	10,76	0,01	1
BTOW3	3.452,37	6,89	0,02	1
BBDC4	3.086,11	6,16	0,00	1
SUZB3	2.635,50	5,26	0,01	1
B3SA3	2.598,96	5,19	0,00	1
QUAL3	2.308,64	4,61	0,03	1
MGLU3	2.144,06	4,28	0,00	1
LAME4	2.126,59	4,25	0,01	1
JSLG3	2.097,07	4,19	0,12	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

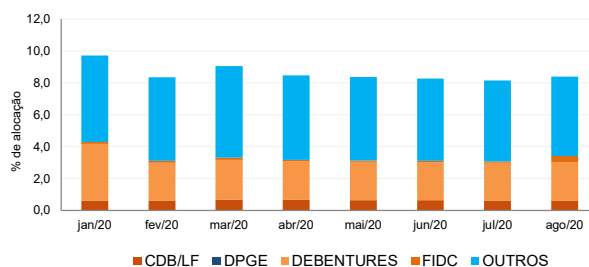
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10.577,47	4,56	Sem Faixa
VALE SA	6.798,15	2,93	Faixa 1
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5.543,66	2,39	Faixa 4
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5.392,36	2,32	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	4.546,34	1,96	Faixa 2
B2W CIA DIGITAL	3.452,37	1,49	Faixa 1
SUZANO S.A.	2.635,50	1,14	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.598,96	1,12	Faixa 1
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SI	2.308,64	0,99	Faixa 1
MAGAZINE LUIZA SA	2.144,06	0,92	Faixa 1

* 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.								

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	32.381	0,01%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	11.322	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	8.831	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	7.076	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	5.095	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3.963	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3.340	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2.661	0,00%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2.208	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.981	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.755	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.698	0,00%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.528	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.472	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.359	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.245	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.245	0,00%	Selic	07-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.132	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	962	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	849	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	679	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	623	0,00%	Selic	13-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	623	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	566	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	509	0,00%	Selic	10-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	453	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	396	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	396	0,00%	Selic	14-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	396	0,00%	Selic	17-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	396	0,00%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	340	0,00%	Selic	12-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	340	0,00%	Selic	06-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	283	0,00%	Selic	14-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	226	0,00%	Selic	11-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	226	0,00%	Selic	13-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	226	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	226	0,00%	Selic	06-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	170	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	170	0,00%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	113	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	113	0,00%	Selic	18-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	113	0,00%	Selic	04-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	113	0,00%	Selic	04-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	396.228	0,17%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	305.662	0,13%	Selic	27-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	152.831	0,07%	Selic	28-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	110.378	0,05%	Selic	25-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	62.264	0,03%	Selic	17-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	56.604	0,02%	Selic	06-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	56.604	0,02%	Selic	17-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	906	0,00%	Selic	25-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	736	0,00%	Selic	25-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	453	0,00%	Selic	20-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	396	0,00%	Selic	19-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	396	0,00%	Selic	28-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	340	0,00%	Selic	28-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	283	0,00%	Selic	27-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	170	0,00%	Selic	25-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	170	0,00%	Selic	28-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	170	0,00%	Selic	31-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	57	0,00%	Selic	20-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.131.770	0,49%	Selic	14-ago-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT