

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2020

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	169,026,616.08	68.80%				0.79%	1.59%	2.67%	4.83%	4.83%	16.47%	28.41%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.91%	4.65%	7.81%	10.91%	10.91%	21.93%	32.62%
Renda Fixa	169,026,616.08	68.80%			0.61%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	46,715,539.75	19.01%		100%	1.96%	0.79%	1.59%	2.67%	6.92%	6.92%	16.74%	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21,975,233.35	8.94%	BB	4.60%	0.17%	0.22%	0.51%	0.78%	2.41%	2.41%	8.27%	14.98%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59,589,066.04	24.25%	BRADESCO	100%	0.15%	0.23%	0.48%	0.89%	2.92%	2.92%	9.03%	15.88%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	39,603,817.72	16.12%	BRADESCO	0.58%	0.12%	0.21%	0.43%	0.73%	2.39%	2.39%	8.31%	15.05%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	80,558.43	0.03%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.47%	1.34%	2.77%	6.35%	6.35%	16.66%	28.46%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	18,211.04	0.01%	BRPP	3.01%		0.47%	1.34%	2.77%	6.35%	6.35%	16.66%	28.46%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	1,044,189.76	0.42%	VILA RICA	0.00%		0.47%	1.34%	2.77%	6.35%	6.35%	16.66%	28.46%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.91%	4.65%	7.81%	10.91%	10.91%	21.93%	32.62%
Renda Variável	58,172,967.66	23.68%				4.92%	18.77%	21.90%	-1.05%	-1.05%	31.91%	54.23%
Benchmark:	IBOVESPA					9.30%	25.81%	25.21%	2.92%	2.92%	35.42%	55.78%
Renda Variável	58,172,967.66	23.68%			10.62%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	8,651,468.76	3.52%		100%	19.23%	4.92%	18.77%	17.76%	-1.07%	-1.07%	-	-
FIOPREV FIA	49,521,498.90	20.16%	QUELUZ	100%	9.27%	3.62%	15.01%	18.63%	-4.17%	-4.17%	29.77%	49.97%
Benchmark:	IBOVESPA					9.30%	25.81%	25.21%	2.92%	2.92%	35.42%	55.78%
Imobiliário	18,067,710.57	7.35%				-0.73%	1.79%	3.99%	6.68%	6.68%	19.59%	28.97%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.91%	4.65%	7.81%	10.91%	10.91%	21.93%	32.62%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11,557,958.00	4.70%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	11,557,958.00	4.70%		100%	2.43%	3.30%	5.62%	8.18%	11.08%	11.08%	-	-
Benchmark:	CDI					0.16%	0.47%	0.99%	2.77%	2.77%	8.90%	15.90%
Imóveis	4,780,000.00	1.95%				-0.06%	-10.47%	-9.45%	-0.06%	-7.37%		
FII	1,729,752.57	0.70%										
VECTOR LAJES FII	1,729,752.57	0.70%	QUELUZ	12.20%		1.91%	3.54%	5.59%	7.78%	7.78%	-25.86%	-20.56%
Benchmark:	IFIX					2.19%	2.69%	2.28%	-10.24%	-10.24%	22.05%	28.91%
Operações com Participantes	417,345.03	0.17%				-1.69%	3.89%	2.14%	-9.64%	-9.64%	52.08%	87.33%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.91%	4.65%	7.81%	10.91%	10.91%	21.93%	32.62%
Total	245,695,278.54	100%			3.01%	1.62%	5.20%	6.75%	3.60%	3.60%	20.17%	32.44%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.82%	4.40%	7.29%	9.86%	9.86%	19.62%	28.88%

* 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.

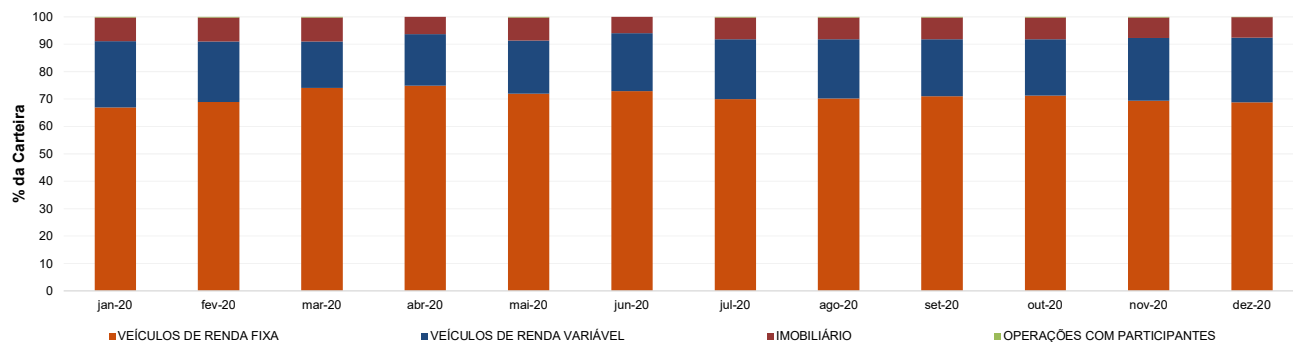
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

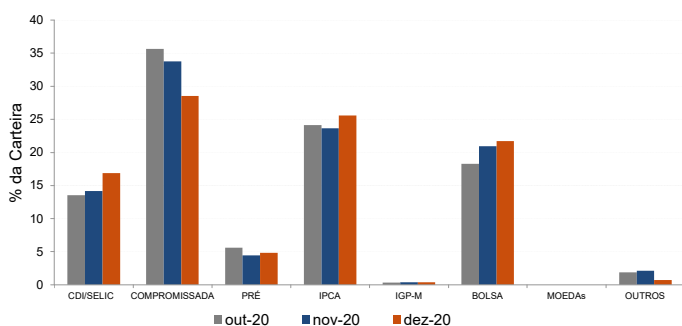
Distribuição da Carteira

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.

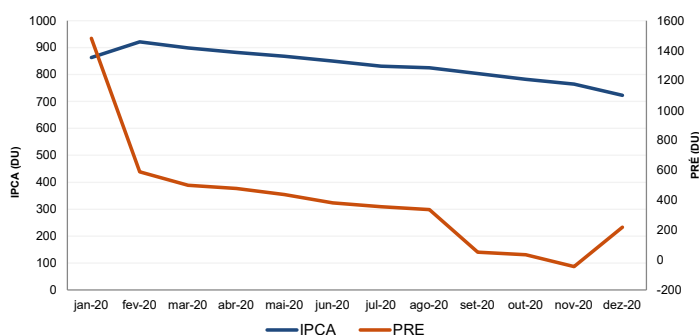
Evolução do Patrimônio Líquido



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	8,649.68	15.97	8,565.18	16.66
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4,566.68	8.43	4,012.36	7.80
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3,514.27	6.49	3,182.57	6.19
SUZB3	Madeira e Papel	3,459.71	6.39	3,339.15	6.50
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	3,418.11	6.31	3,159.48	6.15
RENT3	Diversos	2,861.43	5.28	0.00	
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2,494.05	4.61	1,398.09	2.72
BRML3	Exploração de Imóveis	2,229.48	4.12	0.00	
ITUB4	Intermediários Financeiros	2,078.09	3.84	0.00	
BBDC4	Intermediários Financeiros	2,065.35	3.81	0.00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

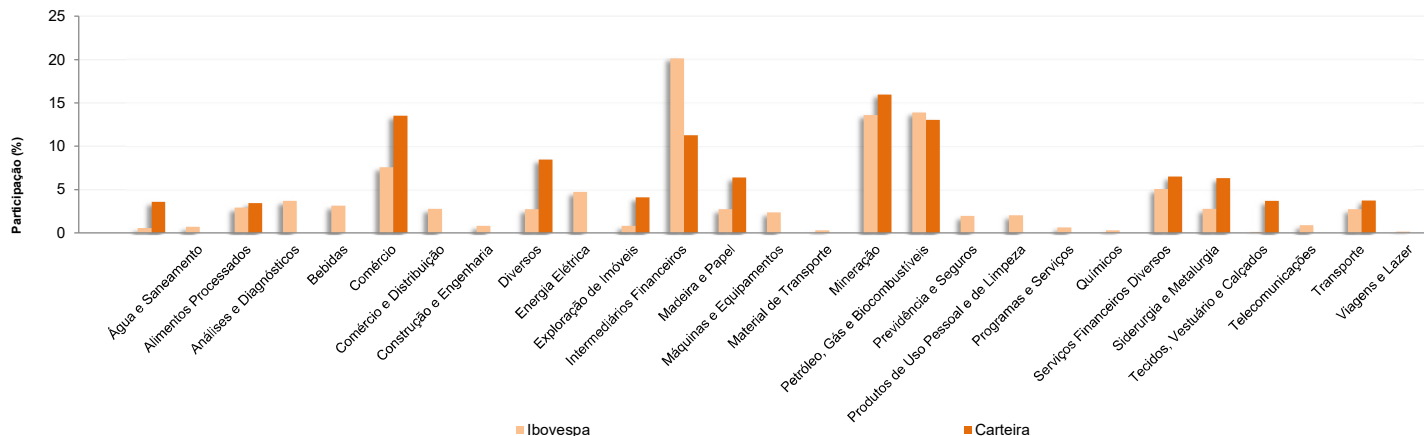
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	8,649.68	15.97	0.00	1
PETR4	4,566.68	8.43	0.00	1
B3SA3	3,514.27	6.49	0.00	1
SUZB3	3,459.71	6.39	0.01	1
GGBR4	3,418.11	6.31	0.01	1
RENT3	2,861.43	5.28	0.01	1
BRDT3	2,494.05	4.61	0.01	1
BRML3	2,229.48	4.12	0.03	1
ITUB4	2,078.09	3.84	0.00	1
BBDC4	2,065.35	3.81	0.00	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.



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2020

Análises de Contrapartes

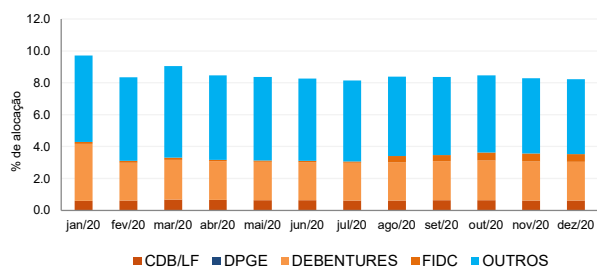
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10,404.09	4.33	Sem Faixa
VALE SA	8,649.68	3.60	Faixa 1
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5,841.96	2.43	Faixa 3
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	4,566.68	1.90	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	3,545.72	1.48	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3,514.27	1.46	Sem Faixa
SUZANO S.A.	3,459.71	1.44	Faixa 1
GERDAU SA	3,418.11	1.42	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	2,861.43	1.19	Faixa 2
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	2,494.05	1.04	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.								

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2020

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 2021-03-01	01-mar-21	504,225	0.21%	Selic	23-dez-20	0.08%	0.08%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	220,598	0.09%	Selic	14-dez-20	6.00%	0.06%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	94,542	0.04%	Selic	04-dez-20	6.00%	0.05%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	63,028	0.03%	Selic	14-dez-20	6.00%	0.06%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	346,487	0.14%	Selic	22-dez-20	0.09%	0.09%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	62,998	0.03%	Selic	04-dez-20	7.00%	0.07%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	377,341	0.16%	Selic	18-dez-20	0.12%	0.12%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LTN 2024-01-01	01-jan-24	2,304,437	0.96%	PRE	17-dez-20	5.56%	0.00%	BRDESCO FI MULT FIOPREV
LTN 2024-01-01	01-jan-24	1,811,122	0.75%	PRE	15-dez-20	5.58%	0.00%	BRDESCO FI MULT FIOPREV
LTN 2024-01-01	01-jan-24	1,207,415	0.50%	PRE	15-dez-20	5.58%	0.00%	BRDESCO FI MULT FIOPREV
LTN 2024-01-01	01-jan-24	476,066	0.20%	PRE	17-dez-20	5.55%	0.00%	BRDESCO FI MULT FIOPREV
LTN 2024-01-01	01-jan-24	238,033	0.10%	PRE	17-dez-20	5.57%	0.00%	BRDESCO FI MULT FIOPREV
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	4,400,400	1.83%	IPCA	14-dez-20	0.03%	0.05%	BRDESCO FI MULT FIOPREV

