

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/03/2021

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	168,666,039.49	69.70%				4.17%	3.06%	4.69%	3.06%	7.75%	17.50%	28.22%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.22%	8.02%	3.22%	12.45%	22.27%	34.57%	
Renda Fixa	168,666,039.49	69.70%			0.53%								
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	42,139,212.52	17.41%		100%	1.89%	0.20%	-0.96%	0.61%	-0.96%	6.56%	12.60%	-	
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,063,654.66	9.12%	BB	3.30%	0.06%	0.17%	0.40%	0.92%	0.40%	1.86%	7.14%	13.67%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59,626,104.38	24.64%	BRADESCO	100%	0.15%	0.09%	0.06%	0.54%	0.06%	2.01%	7.51%	13.98%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	43,729,123.42	18.07%	BRADESCO	0.59%	0.07%	0.19%	0.42%	0.86%	0.42%	1.85%	7.19%	13.78%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	74,290.68	0.03%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.51%	1.32%	2.68%	1.32%	5.78%	15.47%	27.06%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	14,703.93	0.01%	BRPP	3.01%		0.51%	1.32%	2.68%	1.32%	5.78%	15.47%	27.06%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	1,018,949.92	0.42%	VILA RICA	0.00%		0.51%	1.32%	2.68%	1.32%	5.78%	15.47%	27.06%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.22%	8.02%	3.22%	12.45%	22.27%	34.57%	
Renda Variável	55,841,556.77	23.07%				4.79%	-3.66%	14.42%	-3.66%	52.10%	17.30%	32.22%	
Benchmark:	IBOVESPA					6.00%	-2.00%	23.29%	-2.00%	59.73%	22.24%	36.63%	
Renda Variável	55,841,556.77	23.07%			10.66%								
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	8,459,628.60	3.50%		100%	15.17%	8.36%	-85.10%	-82.30%	-85.10%	-75.02%	-	-	
FIOPREV FIA	47,381,928.17	19.58%	QUELUZ	100%	10.21%	4.17%	-4.32%	10.04%	-4.32%	45.08%	15.55%	28.76%	
Benchmark:	IBOVESPA					6.00%	-2.00%	23.29%	-2.00%	59.73%	22.24%	36.63%	
Imobiliário	17,090,019.21	7.06%				0.38%	-0.28%	1.50%	-0.28%	5.03%	15.64%	27.33%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.22%	8.02%	3.22%	12.45%	22.27%	34.57%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	11,052,278.75	4.57%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	11,052,278.75	4.57%		100%	1.82%	0.44%	-70.31%	-68.64%	-70.31%	-67.52%	-	-	
Benchmark:	CDI					0.20%	0.48%	0.96%	0.48%	2.23%	7.80%	14.63%	
Imóveis	4,772,051.27	1.97%				-0.06%	-0.17%	-10.23%	-0.17%	-8.17%			
FII	1,265,689.19	0.52%											
VECTOR LAJES FII	1,265,689.19	0.52%	QUELUZ	0.00%		-6.45%	-8.26%	-5.01%	-8.26%	-0.59%	-32.92%	-28.69%	
Benchmark:	IFIX					-1.38%	-0.81%	1.86%	-0.81%	14.14%	14.65%	20.75%	
Operações com Participantes	387,505.24	0.16%				-1.01%	-4.80%	-1.10%	-4.80%	-8.72%	-10.41%	124.32%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.22%	8.02%	3.22%	12.45%	22.27%	34.57%	
Total	242,005,471.61	100%				2.89%	1.19%	-0.99%	4.16%	-0.99%	12.48%	14.76%	25.18%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.24%	2.98%	7.52%	2.98%	11.39%	19.95%	30.78%	

* 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.

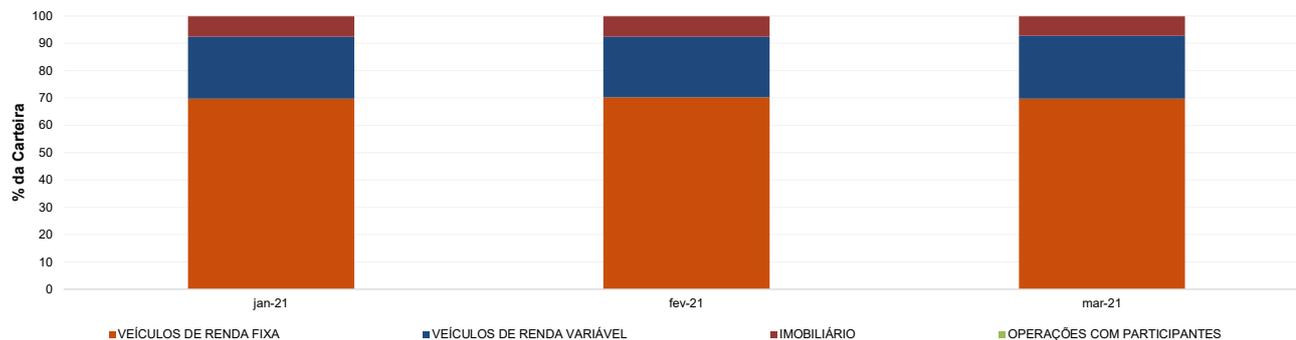
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

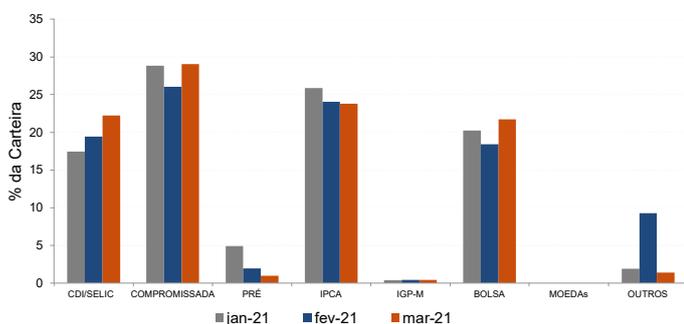
Distribuição da Carteira

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.

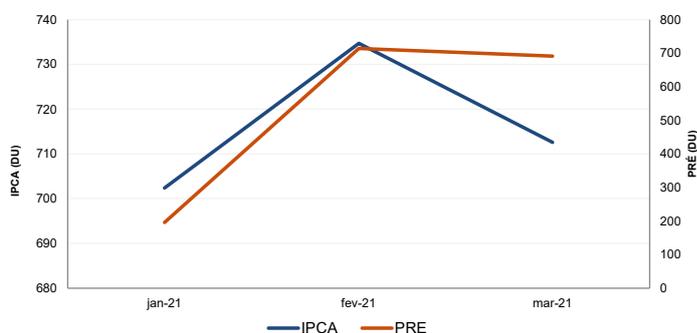
Evolução do Patrimônio Líquido



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	9,259.14	17.37	9,348.97	20.67
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5,948.82	11.16	3,583.73	7.93
ITUB4	Intermediários Financeiros	4,620.64	8.67	3,101.77	6.86
BBDC4	Intermediários Financeiros	4,593.73	8.62	3,516.70	7.78
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3,277.20	6.15	2,568.39	5.68
WEGE3	Máquinas e Equipamentos	2,564.86	4.81	1,717.10	3.80
MOV13	Diversos	2,272.98	4.26	2,401.89	5.31
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	2,172.82	4.08	1,844.53	4.08
MGLU3	Comércio	2,062.46	3.87	1,576.54	3.49
IGTA3	Exploração de Imóveis	2,027.08	3.80	0.00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

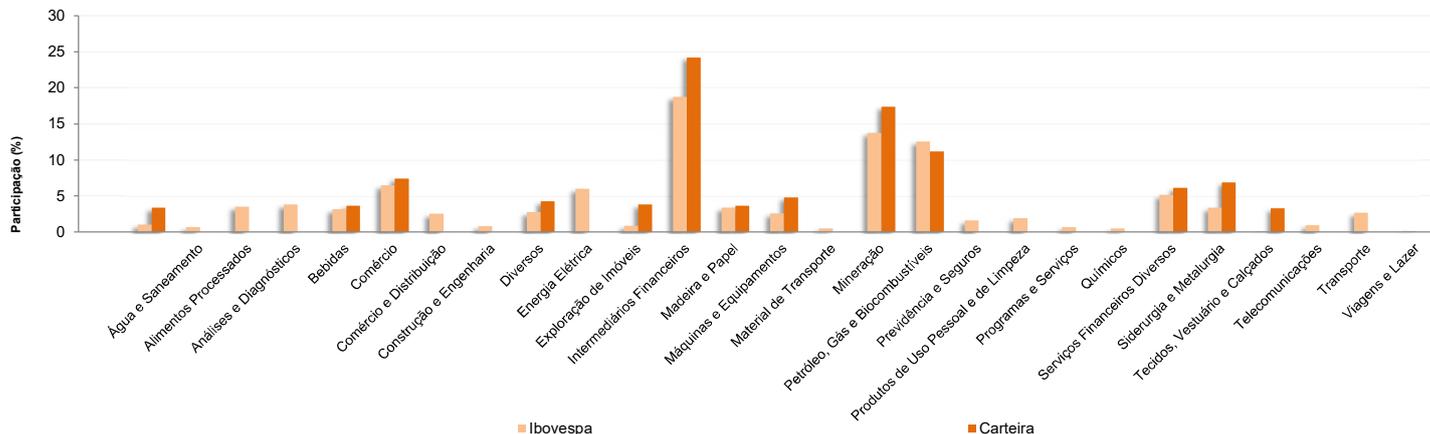
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	9,259.14	17.37	0.00	1
PETR4	5,948.82	11.16	0.01	1
ITUB4	4,620.64	8.67	0.00	1
BBDC4	4,593.73	8.62	0.00	1
B3SA3	3,277.20	6.15	0.00	1
WEGE3	2,564.86	4.81	0.00	1
MOV13	2,272.98	4.26	0.10	1
GGBR4	2,172.82	4.08	0.01	1
MGLU3	2,062.46	3.87	0.00	1
IGTA3	2,027.08	3.80	0.06	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

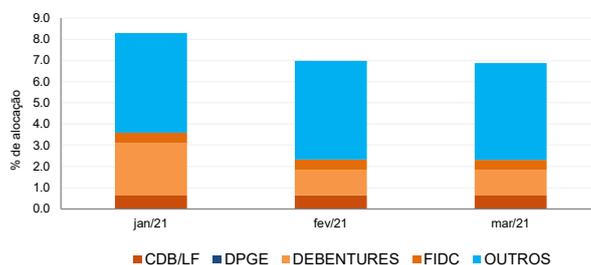
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	9,845.71	4.16	Sem Faixa
VALE SA	9,259.14	3.91	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	6,089.28	2.57	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5,948.82	2.52	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,620.64	1.95	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3,277.20	1.39	Sem Faixa
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	2,876.80	1.22	Faixa 3
WEG SA	2,564.86	1.08	Sem Faixa
MOVIDA PARTICIPACOES	2,272.98	0.96	Faixa 2
GERDAU SA	2,172.82	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.								

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/03/2021

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 2021-09-01	01-set-21	237,875	0.10%	Selic	01-mar-21	6.00%	0.05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	73,628	0.03%	Selic	16-mar-21	4.00%	0.04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	4,090	0.00%	Selic	16-mar-21	4.00%	0.04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2,515,845	1.06%	Selic	26-mar-21	0.12%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1,069,234	0.45%	Selic	05-mar-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	213,847	0.09%	Selic	26-mar-21	0.12%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	188,688	0.08%	Selic	26-mar-21	0.12%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	50,317	0.02%	Selic	26-mar-21	0.12%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	36,443	0.02%	Selic	26-mar-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	554,989	0.23%	Selic	09-mar-21	0.14%	0.14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1,882,100	0.80%	Selic	25-mar-21	0.14%	0.13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2,191,547	0.93%	Selic	25-mar-21	0.18%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1,590,249	0.67%	Selic	01-mar-21	0.17%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	242,009	0.10%	Selic	18-mar-21	0.18%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	121,161	0.05%	Selic	18-mar-21	0.18%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	93,923	0.04%	Selic	26-mar-21	0.18%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	325,207	0.14%	Selic	09-mar-21	0.17%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	312,699	0.13%	Selic	26-mar-21	0.18%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	567,007	0.24%	Selic	09-mar-21	0.19%	0.19%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

