

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/07/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>237,909,499.75</b>	<b>96.97%</b>				<b>-9.60%</b>	<b>3.34%</b>	<b>3.64%</b>	<b>3.71%</b>	<b>5.77%</b>	<b>13.85%</b>	<b>25.47%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.47%	3.93%	7.40%	8.12%	15.52%	24.82%	35.41%
<b>Renda Fixa</b>	<b>237,909,499.75</b>	<b>96.97%</b>			<b>0.07%</b>							
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,304,011.00	9.09%	BB	3.40%	0.04%	0.37%	0.95%	1.34%	1.50%	2.11%	6.15%	12.63%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	60,204,836.63	24.54%	BRADESCO	100%	0.19%	0.16%	0.71%	0.95%	1.03%	1.71%	6.21%	13.02%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	154,405,743.61	62.94%	BRADESCO	1.74%	0.05%	0.38%	0.97%	1.38%	1.53%	2.09%	6.19%	12.74%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	60,768.32	0.02%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.66%	1.82%	3.22%	3.66%	5.99%	14.36%	25.84%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	10,689.25	0.00%	BRPP	3.01%		0.66%	1.82%	3.22%	3.66%	5.99%	14.36%	25.84%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	923,450.94	0.38%	VILA RICA	1.88%		0.66%	1.82%	3.22%	3.66%	5.99%	14.36%	25.84%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.47%	3.93%	7.40%	8.12%	15.52%	24.82%	35.41%
<b>Imobiliário</b>	<b>6,948,296.39</b>	<b>2.83%</b>				<b>1.71%</b>	<b>-1.74%</b>	<b>-0.16%</b>	<b>-0.26%</b>	<b>1.42%</b>	<b>10.06%</b>	<b>25.72%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.47%	3.93%	7.40%	8.12%	15.52%	24.82%	35.41%
<b>Imóveis</b>	<b>4,761,452.97</b>	<b>1.94%</b>				<b>-0.06%</b>	<b>-0.22%</b>	<b>-0.33%</b>	<b>-0.39%</b>	<b>-9.75%</b>		
<b>CARTEIRA PRÓPRIA IM</b>	<b>1,126,944.58</b>	<b>0.46%</b>										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	1,126,944.58	0.46%		100%	2.16%	-0.38%	-5.13%	-4.75%	-71.17%	-69.73%	-	-
Benchmark:	CDI					0.36%	0.93%	1.48%	1.63%	2.43%	6.77%	13.54%
<b>FII</b>	<b>1,059,898.84</b>	<b>0.43%</b>										
VECTOR LAJES FII	1,059,898.84	0.43%	QUELUZ	12.20%		-3.12%	140.80%	-7.91%	-9.37%	-5.64%	-33.52%	-30.29%
Benchmark:	IFIX					2.51%	-1.29%	-1.92%	-1.60%	3.33%	6.19%	31.08%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>220,623.70</b>	<b>0.09%</b>				<b>-39.21%</b>	<b>-43.50%</b>	<b>-44.32%</b>	<b>-45.48%</b>	<b>-43.38%</b>	<b>-48.70%</b>	<b>29.14%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.47%	3.93%	7.40%	8.12%	15.52%	24.82%	35.41%
<b>Total</b>	<b>245,335,984.78</b>	<b>100%</b>			<b>2.72%</b>	<b>-9.38%</b>	<b>1.22%</b>	<b>2.18%</b>	<b>0.90%</b>	<b>5.15%</b>	<b>11.62%</b>	<b>27.77%</b>
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.38%	3.68%	6.89%	7.53%	14.43%	22.47%	31.60%

\* 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.

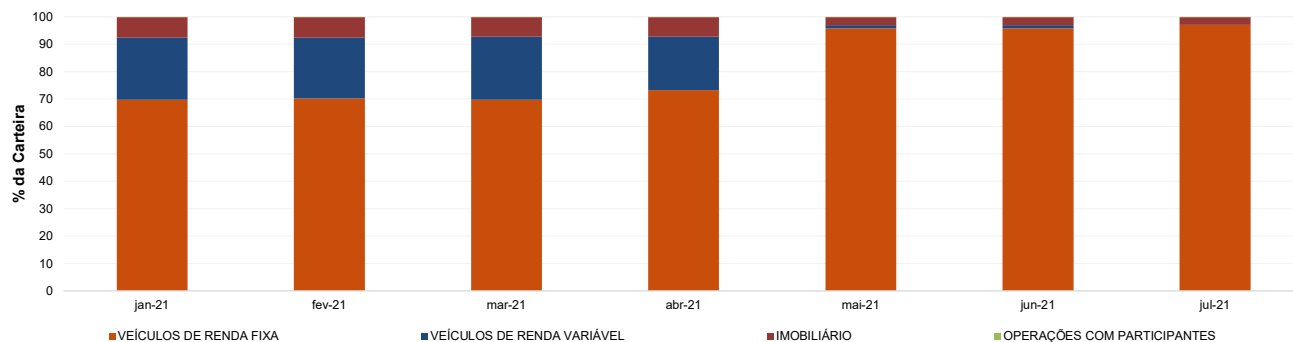
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

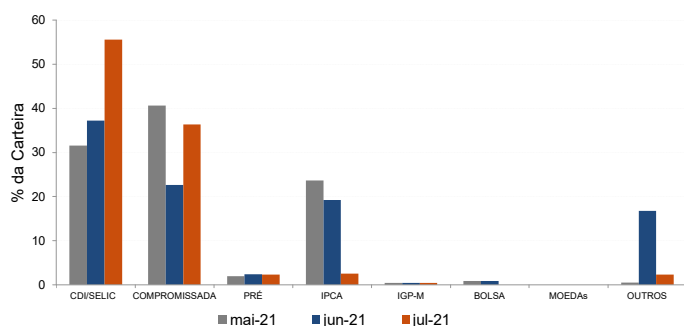
## Distribuição da Carteira

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.

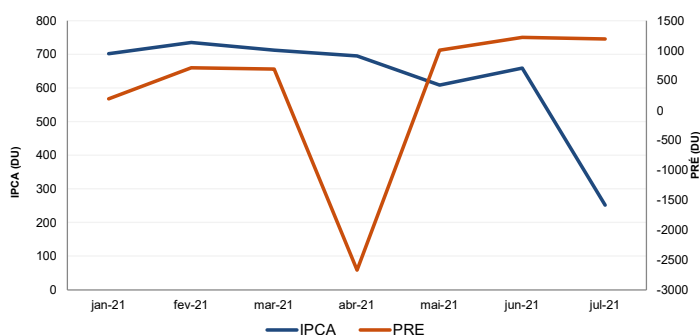
## Evolução do Patrimônio Líquido



## Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



## Evolução da Duration



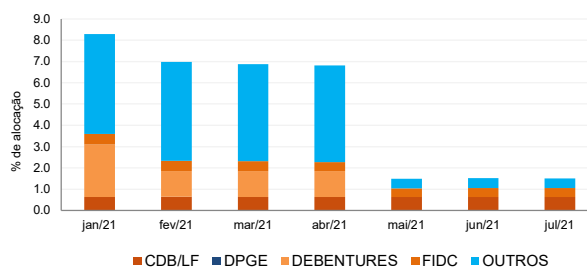
## Análises de Contrapartes

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
BCO BRADESCO SA	1,523.86	0.63	Faixa 1
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,094.86	0.46	Sem Faixa

### Alocação Por Tipo de Crédito



\* em mil R\$

## 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: 30/07/2021

## 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	228,694	0.10%	Selic	07-jul-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	47,645	0.02%	Selic	12-jul-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	6,001,271	2.50%	Selic	05-jul-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	476,291	0.20%	Selic	07-jul-21	0.12%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	952,259	0.40%	Selic	28-jul-21	7.00%	0.07%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	380,904	0.16%	Selic	13-jul-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	168,550	0.07%	Selic	13-jul-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	3,798,988	1.58%	Selic	09-jul-21	0.15%	0.15%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

