

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/10/2021

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	169,598,760.45	96.12%				0.42%	0.85%	4.22%	4.59%	5.97%	11.26%	23.42%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.57%	4.59%	8.70%	13.08%	16.81%	28.69%	38.84%
Renda Fixa	169,598,760.45	96.12%			0.03%							
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	1,769,280.22	1.00%	BB	0.28%	0.03%	0.51%	1.39%	2.35%	2.90%	3.25%	6.14%	12.47%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	5,674,972.66	3.22%	BRADESCO	100%	0.00%	0.23%	0.82%	1.54%	1.86%	2.24%	5.53%	12.20%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	162,145,088.22	91.90%	BRADESCO	1.80%	0.03%	0.51%	1.38%	2.36%	2.93%	3.27%	6.16%	12.55%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	1,941.00	0.00%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.76%	2.22%	4.08%	5.97%	6.91%	14.19%	25.52%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	7,478.36	0.00%	BRPP	3.01%		0.76%	2.22%	4.08%	5.97%	6.91%	14.19%	25.52%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.57%	4.59%	8.70%	13.08%	16.81%	28.69%	38.84%
Imobiliário	6,355,964.55	3.60%				-0.63%	-1.67%	-3.38%	-1.93%	-1.21%	4.82%	19.00%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.57%	4.59%	8.70%	13.08%	16.81%	28.69%	38.84%
Imóveis	4,753,504.24	2.69%				-0.06%	-0.17%	-0.39%	-0.55%	-10.92%		
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1,050,254.53	0.60%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARIA	1,050,254.53	0.60%		100%	2.98%	-2.59%	-5.21%	-10.07%	-72.67%	-71.30%	-	-
Benchmark:	CDI					0.48%	1.35%	2.29%	3.00%	3.32%	6.65%	13.28%
FII	552,205.78	0.31%										
VECTOR LAJES FII	552,205.78	0.31%	QUELUZ	12.20%		0.00%	-3.76%	133.92%	-11.96%	-13.64%	-36.93%	-34.12%
Benchmark:	IFIX					-1.47%	-5.26%	-6.48%	-6.78%	-3.29%	-4.17%	19.32%
Operações com Participantes	182,335.70	0.10%				-8.07%	-12.22%	-50.41%	-52.14%	-54.06%	-55.95%	-7.00%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.57%	4.59%	8.70%	13.08%	16.81%	28.69%	38.84%
Total	176,444,637.82	100%			0.09%	0.39%	0.77%	2.01%	1.68%	7.00%	8.43%	23.51%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.49%	4.34%	8.18%	12.20%	15.71%	26.28%	34.94%

* 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.

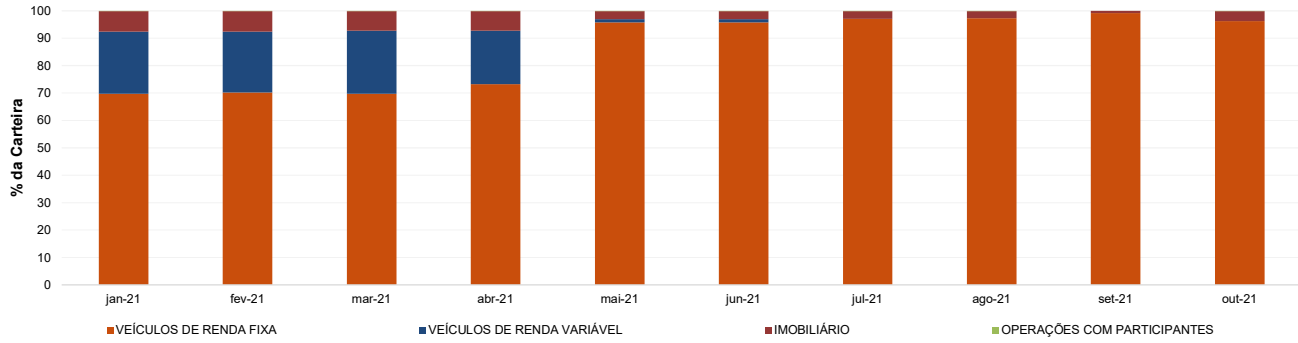
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

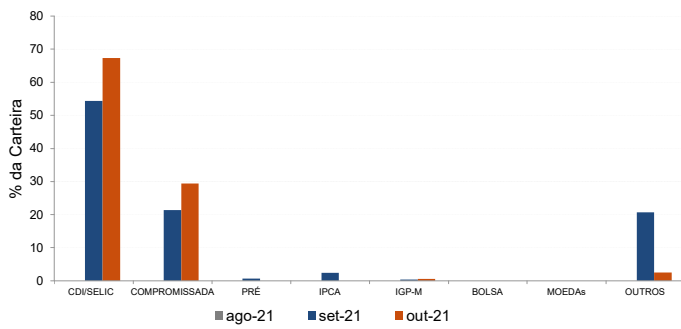
Distribuição da Carteira

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.

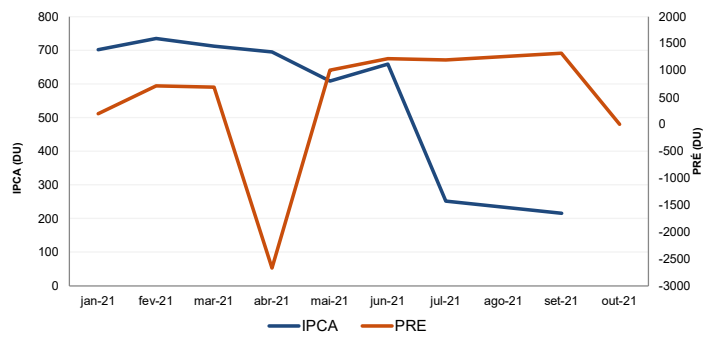
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

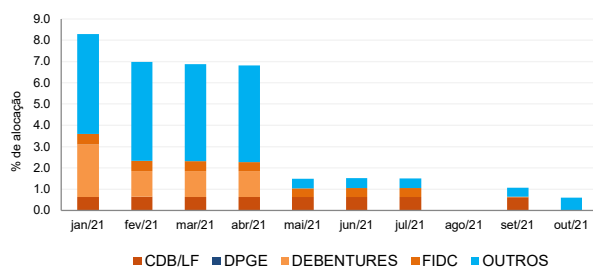
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,009.18	0.59	Sem Faixa

* 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: 29/10/2021

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 2022-03-01	01-mar-22	2,985,738	1.74%	Selic	05-out-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	995,246	0.58%	Selic	19-out-21	0.02%	0.02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	4,976	0.00%	Selic	19-out-21	0.01%	0.01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	796,037	0.46%	Selic	05-out-21	4.00%	0.04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2,779,812	1.62%	Selic	28-out-21	0.11%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	496,395	0.29%	Selic	05-out-21	0.15%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

