

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/11/2021

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	170,064,250.29	96.43%				0.42%	0.93%	-8.31%	5.03%	5.86%	11.68%	23.40%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.25%	4.51%	8.55%	14.49%	16.68%	29.08%	40.36%
Renda Fixa	170,064,250.29	96.43%			0.03%							
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	170,057,375.85	96.43%	BRADESCO	1.84%	0.03%	0.57%	1.53%	2.66%	3.52%	3.73%	6.37%	12.65%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	0.00	0.00%	BRASIL PLURAL	0.00%		0.86%	2.36%	4.40%	6.88%	7.38%	14.42%	25.64%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	6,874.44	0.00%	BRPP	3.01%		0.86%	2.36%	4.40%	6.88%	7.38%	14.42%	25.64%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.25%	4.51%	8.55%	14.49%	16.68%	29.08%	40.36%
Imobiliário	5,816,558.72	3.30%				-0.63%	-1.47%	0.25%	-2.54%	-3.26%	1.51%	17.54%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.25%	4.51%	8.55%	14.49%	16.68%	29.08%	40.36%
Imóveis	4,750,854.67	2.69%				-0.06%	-0.17%	0.33%	-0.61%	-10.68%	-7.11%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1,065,704.05	0.60%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	1,065,704.05	0.60%		100%	4.69%	2.87%	-1.78%	1.10%	-71.89%	-70.96%	-68.77%	-
Benchmark:	CDI					0.59%	1.51%	2.62%	3.60%	3.77%	6.87%	13.38%
Operações com Participantes	166,636.01	0.09%				-8.07%	-17.45%	-51.68%	-56.01%	-56.75%	-60.97%	-19.68%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.25%	4.51%	8.55%	14.49%	16.68%	29.08%	40.36%
Total	176,354,689.94	100%			0.03%	0.39%	0.85%	-8.19%	2.08%	3.73%	8.42%	23.40%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.17%	4.27%	8.04%	13.51%	15.58%	26.65%	36.42%

* 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.

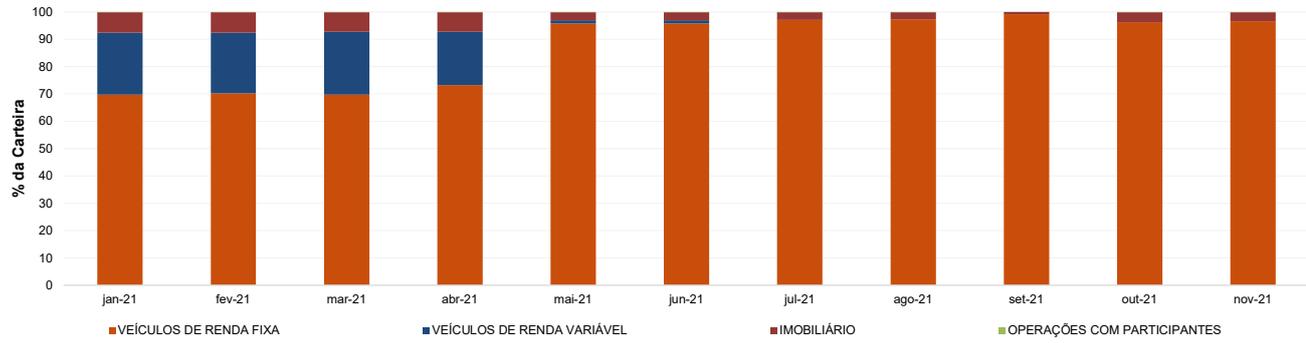
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

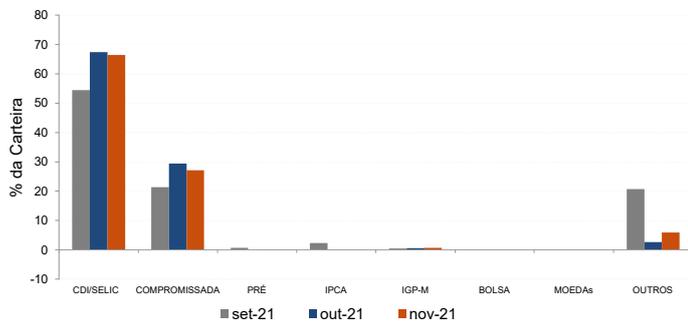
Distribuição da Carteira

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.

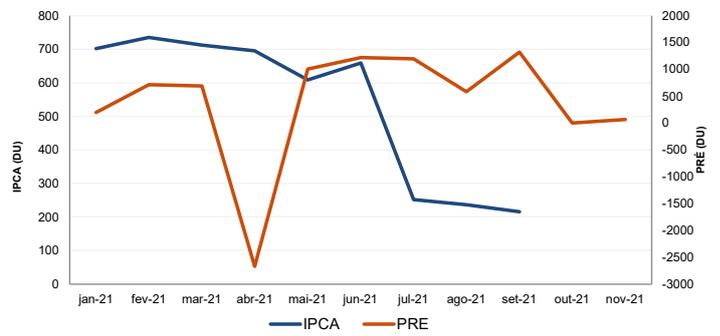
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

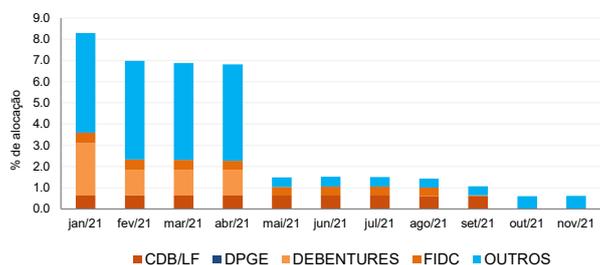
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,063.72	0.62	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: 30/11/2021

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	3,081,130	1.80%	Selic	19-nov-21	4.00%	0.04%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1,211,911	0.71%	Selic	03-nov-21	0.02%	0.02%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	246,490	0.14%	Selic	22-nov-21	4.00%	0.04%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	205,409	0.12%	Selic	22-nov-21	4.00%	0.04%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	153,029	0.09%	Selic	05-nov-21	0.02%	0.02%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	3,080,744	1.80%	Selic	19-nov-21	0.02%	0.02%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	2,053,829	1.20%	Selic	22-nov-21	0.02%	0.02%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	20,538	0.01%	Selic	22-nov-21	0.02%	0.02%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	2,041,788	1.19%	Selic	09-nov-21	0.17%	0.17%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1,018,497	0.59%	Selic	09-nov-21	0.22%	0.00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

