

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2021

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.

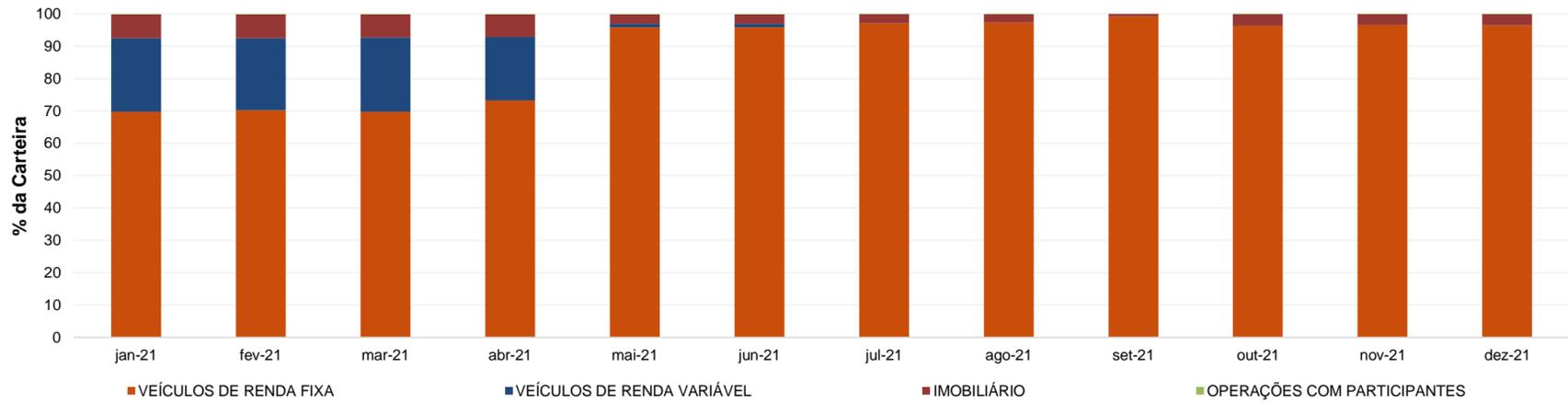
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	160.637.834,10	96,36%				0,73%	1,72%	2,47%	3,36%	3,36%	8,35%	20,39%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,20%	4,06%	8,74%	15,87%	15,87%	28,50%	41,27%
Renda Fixa	160.637.834,10	96,36%			0,03%							
BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	160.631.331,32	96,35%	BRDESCO	1,92%	0,03%	0,73%	1,82%	3,09%	4,28%	4,28%	6,77%	12,94%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	0,00	0,00%	BRASIL PLURAL	0,00%		1,08%	2,72%	4,90%	8,03%	8,03%	14,89%	26,03%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	6.502,78	0,00%	BRPP	3,01%		1,08%	2,72%	4,90%	8,03%	8,03%	14,89%	26,03%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,20%	4,06%	8,74%	15,87%	15,87%	28,50%	41,27%
Imobiliário	5.805.384,97	3,48%				0,60%	0,14%	0,79%	-1,17%	-1,17%	5,44%	18,19%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,20%	4,06%	8,74%	15,87%	15,87%	28,50%	41,27%
Imóveis	4.748.205,10	2,85%				-0,06%	-0,17%	-0,33%	-0,67%	-0,67%	-7,16%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1.057.179,87	0,63%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR	1.057.179,87	0,63%		100%	3,33%	3,57%	3,78%	0,61%	-2,18%	-2,18%	8,65%	-
Benchmark:	CDI					0,76%	1,84%	3,09%	4,40%	4,40%	7,28%	13,69%
Operações com Participantes	157.650,74	0,09%				1,72%	8,06%	0,99%	-9,42%	-9,42%	-18,15%	37,76%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,20%	4,06%	8,74%	15,87%	15,87%	28,50%	41,27%
Total	166.715.542,47	100%			0,03%	0,73%	1,68%	2,30%	3,08%	3,08%	6,79%	23,87%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1,11%	3,82%	8,21%	14,77%	14,77%	26,08%	37,29%

* 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.

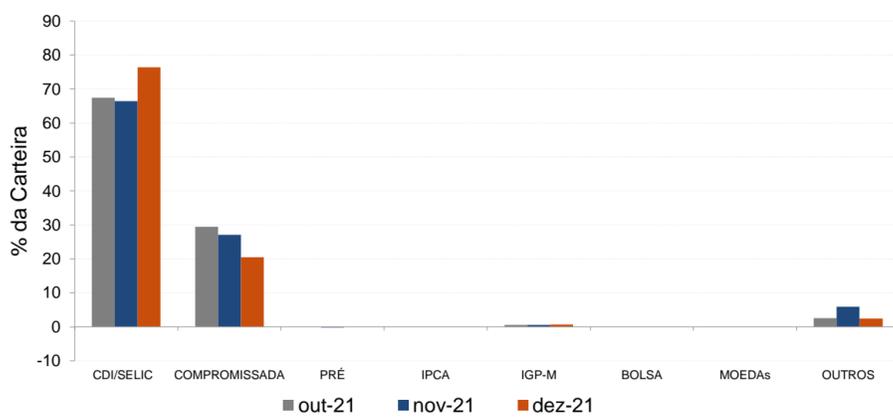
Distribuição da Carteira

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.

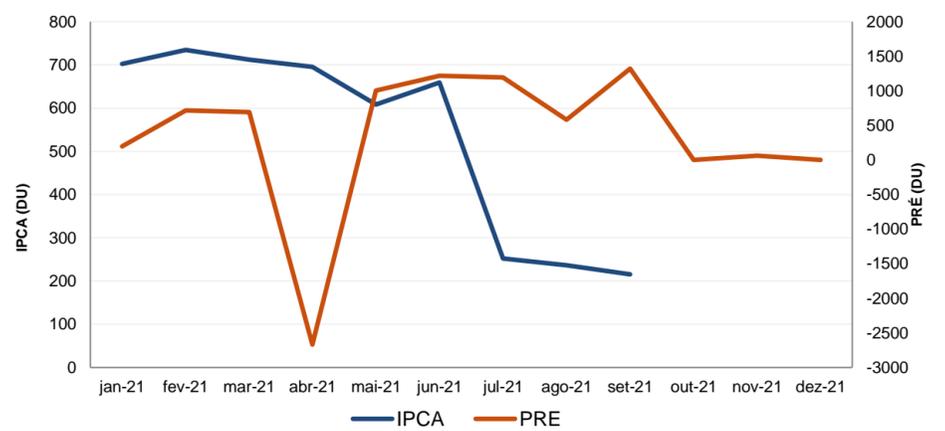
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2021

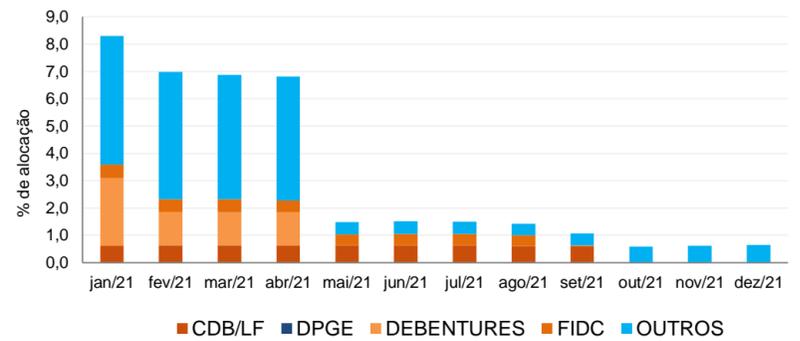
Análises de Contrapartes

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	1.046,72	0,65	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: 31/12/2021

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	4.310.230	2,66%	Selic	27-dez-21	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	366.370	0,23%	Selic	03-dez-21	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	43.102	0,03%	Selic	27-dez-21	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.077.302	0,67%	Selic	14-dez-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	21.546	0,01%	Selic	02-dez-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	6.462	0,00%	Selic	03-dez-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.223.793	1,99%	Selic	09-dez-21	0,11%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

