

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/07/2017

O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações contidas nesse relatório foram extraídas dos relatórios de risco já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

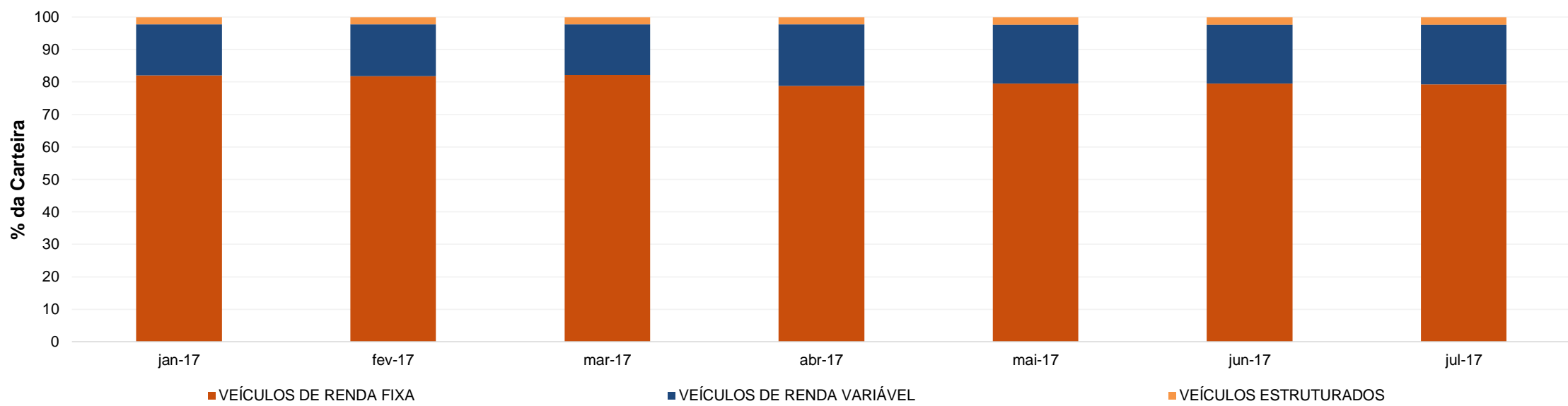
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	149.791.078,29	79,22%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0,62%	1,60%	3,54%	4,46%	7,67%	24,40%	44,14%	
Renda Fixa	149.200.676,46	78,91%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	56.782.001,35	30,03%		100,00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO FI MULT FIOPREV	48.080.749,71	25,43%	BRADESCO	100,00%	-	0,79%	2,51%	5,61%	6,88%	13,14%	28,46%	-	
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	17.868.216,28	9,45%	BB	3,19%	-	0,79%	2,54%	5,30%	6,42%	12,31%	27,74%	42,87%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	26.469.709,12	14,00%	BRADESCO	0,48%	-	0,80%	2,61%	5,38%	6,51%	12,40%	27,85%	43,10%	
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0,62%	1,60%	3,54%	4,46%	7,67%	24,40%	44,14%	
FIDC	590.401,83	0,31%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC MULTISSETORIAL MASTER SEM	196.449,33	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%	-	1,09%	3,46%	7,14%	8,63%	16,45%	37,37%	59,36%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	15.995,75	0,01%	BRASIL PLURAL	1,06%	-	1,09%	3,46%	7,14%	8,63%	16,45%	37,37%	59,36%	
FIDC ITALIA SENIOR SEN	377.956,75	0,20%	VILA RICA	1,88%	-	1,09%	3,46%	7,14%	8,63%	16,45%	37,37%	59,36%	
Benchmark:	CDI					0,80%	2,56%	5,36%	6,50%	12,53%	28,29%	43,77%	
Renda Variável	34.966.413,98	18,49%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					4,80%	0,79%	1,93%	9,45%	15,03%	29,60%	18,07%	
Renda Variável	34.966.413,98	18,49%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	4.814.252,24	2,55%		100,00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	30.152.161,74	15,95%	QUELUZ	100,00%	-	4,30%	2,04%	5,02%	10,52%	6,92%	17,68%	17,67%	
Benchmark:	IBOVESPA					4,80%	0,79%	1,93%	9,45%	15,03%	29,60%	18,07%	
Estruturados	4.324.448,22	2,29%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0,70%	1,85%	4,02%	5,03%	8,69%	26,75%	48,26%	
FII	4.324.448,22	2,29%			-	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR LAJES FII	4.324.448,22	2,29%	QUELUZ	6,81%	-	1,95%	2,53%	5,12%	6,21%	9,91%	-	-	
Benchmark:	IFIX					-0,39%	1,52%	6,83%	10,84%	19,08%	40,54%	46,63%	
Total	189.076.828,33	100,00%			1,99%	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.					0,54%	1,36%	3,06%	3,89%	6,65%	22,06%	40,09%	

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatórios foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

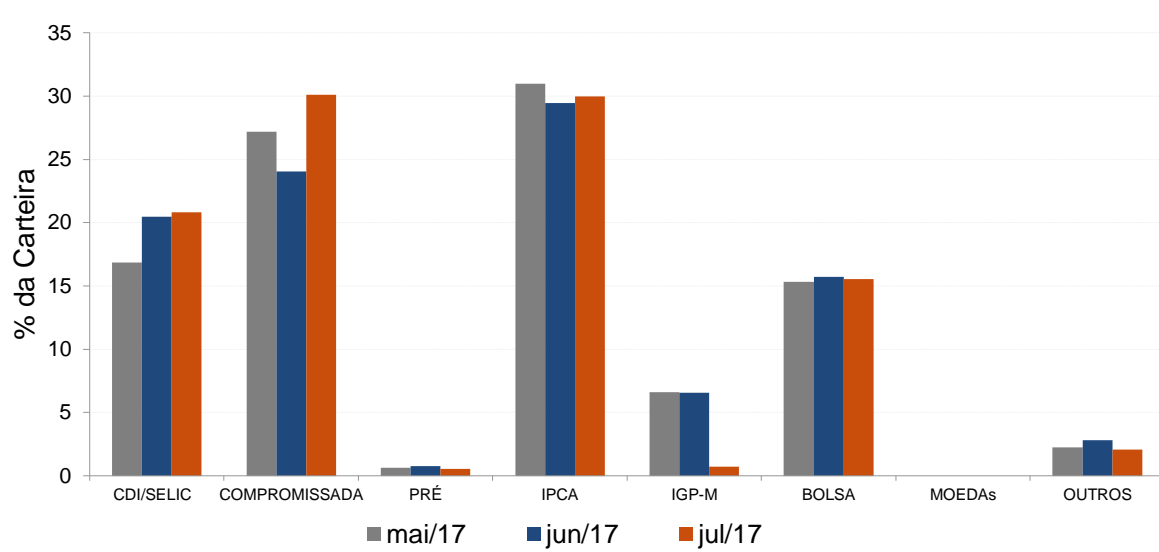
Distribuição da Carteira

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.

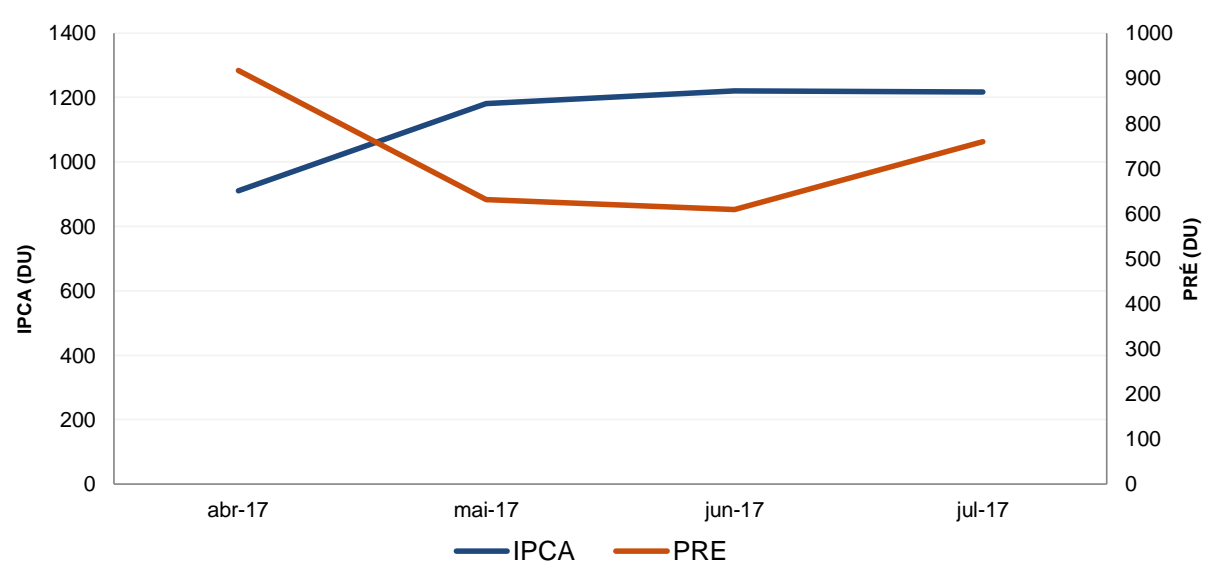
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.737,67	12,69	3.403,47	11,69
BBDC4	Intermediários Financeiros	2.804,65	9,52	1.787,53	6,14
VIVT4	Telefonia Fixa	2.788,59	9,47	2.132,75	7,33
EQTL3	Energia Elétrica	2.738,61	9,30	2.887,79	9,92
ITUB4	Intermediários Financeiros	2.705,70	9,19	2.664,38	9,15
LAME4	Comércio	2.008,89	6,82	814,80	2,80
BVMF3	Serviços Financeiros Diversos	1.495,81	5,08	2.632,71	9,04
VALE5	Mineração	1.458,50	4,95	1.345,50	4,62
BRML3	Exploração de Imóveis	1.415,04	4,80	1.281,04	4,40
SMLE3	Diversos	1.256,24	4,27	893,62	3,07

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

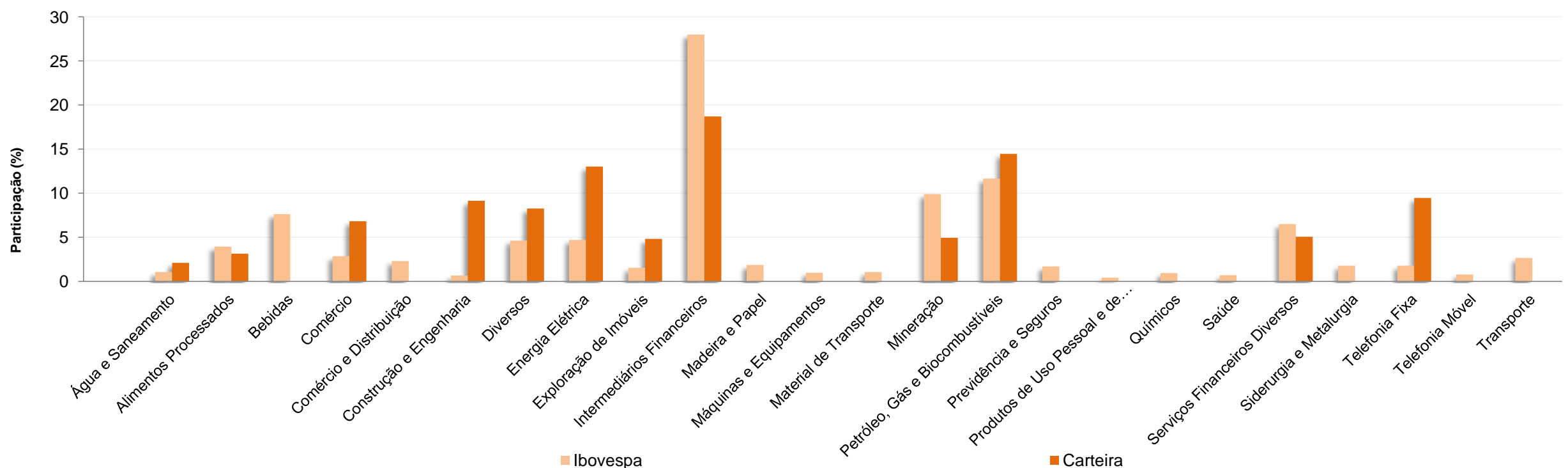
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmorte
JFEN3	1.214,21	4,12	2,44	133
PETR4	3.737,67	12,69	0,01	1
BBDC4	2.804,65	9,52	0,00	1
VIVT4	2.788,59	9,47	0,01	1
EQTL3	2.738,61	9,30	0,02	1
ITUB4	2.705,70	9,19	0,00	1
LAME4	2.008,89	6,82	0,02	1
BVMF3	1.495,81	5,08	0,00	1
VALE5	1.458,50	4,95	0,00	1
BRML3	1.415,04	4,80	0,01	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

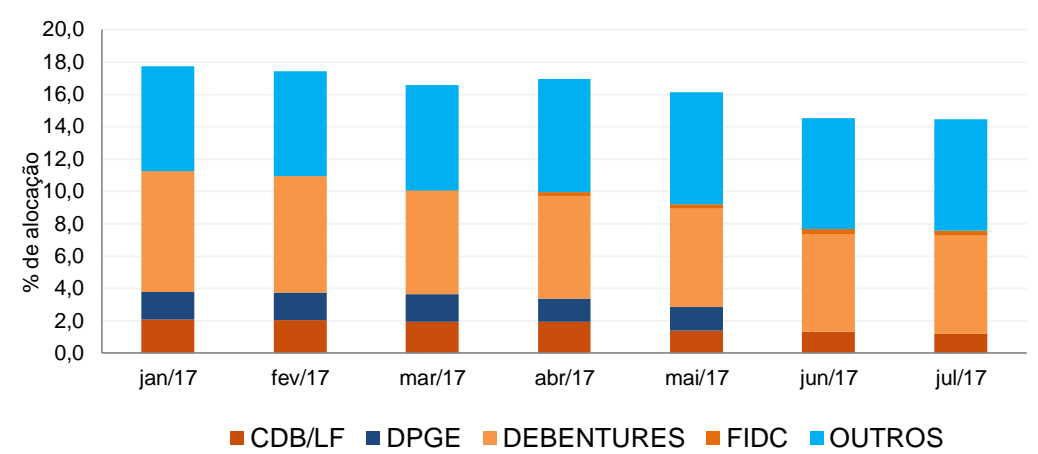
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	11.696,49	6,18			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	6.489,22	3,43	BBB (bra)	Ba1.br	brBB+
ALGAR TELECOM S.A	4.400,34	2,32			brAA-
BCO BRADESCO SA	4.144,41	2,19	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	3.737,67	1,97	AA+ (bra)	Aaa.br	brA
TELEFONICA BRASIL SA	2.788,59	1,47		Aaa.br	brAAA
EQUATORIAL ENERGIA SA	2.738,61	1,45			
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.705,70	1,43	AAA (bra)	A1.br	brAA-
LOJAS AMERICANAS SA	2.008,89	1,06	AA- (bra)		
BM&FBOVESPA SA BOLSA DE VALORES	1.495,81	0,79		Aaa.br	

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Rating no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de rating encontrada.									

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 investidos.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2017-09-07	07-set-17	133.926	0,07%	Selic	26-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	34.450	0,02%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	947	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	732	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	689	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	517	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	474	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	474	0,00%	Selic	31-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	431	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	388	0,00%	Selic	07-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	388	0,00%	Selic	07-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	301	0,00%	Selic	05-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	301	0,00%	Selic	07-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	215	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	215	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	31-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	07-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	28-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	14-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	17-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	172	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	31-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	06-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	14-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	18-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	129	0,00%	Selic	27-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	31-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	06-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	06-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	12-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	14-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	86	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	43	0,00%	Selic	06-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	43	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	43	0,00%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2017-09-07	07-set-17	43	0,00%	Selic	25-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	15.675	0,01%	Selic	17-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	129	0,00%	Selic	05-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	2.455	0,00%	Selic	12-jul-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	129	0,00%	Selic	05-jul-17	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	8.612	0,00%	Selic	07-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	258	0,00%	Selic	05-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	426.946	0,23%	Selic	17-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	35.733	0,02%	Selic	12-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	172	0,00%	Selic	05-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	301	0,00%	Selic	05-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	215	0,00%	Selic	05-jul-17	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	150.645	0,08%	Selic	12-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	57.073	0,03%	Selic	12-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	11.105	0,01%	Selic	17-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	258	0,00%	Selic	05-jul-17	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	107.584	0,06%	Selic	04-jul-17	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	774.559	0,41%	Selic	28-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	731.528	0,39%	Selic	28-jul-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	330.600	0,17%	IPCA	31-jul-17	5,25%	5,21%	BRADESCO FI MULT FIOPREV