

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/09/2017

Este relatório apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o 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	151.723.808,90	75,64%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,41%	1,49%	2,96%	5,37%	7,17%	23,42%	43,10%		
Renda Fixa	151.137.726,13	75,35%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	55.549.034,08	27,69%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO FI MULT FIOPREV	50.312.987,45	25,08%	BRADESCO	100%	0,65%	2,32%	4,99%	8,50%	12,22%	28,03%	-		
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	18.121.117,14	9,03%	BB	3,09%	0,63%	2,22%	4,80%	7,93%	11,36%	26,77%	42,42%		
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.154.587,45	13,54%	BRADESCO	0,51%	0,63%	2,24%	4,88%	8,03%	11,46%	26,88%	42,65%		
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,41%	1,49%	2,96%	5,37%	7,17%	23,42%	43,10%		
FIDC	586.082,78	0,29%											
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	205.764,01	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%	0,92%	3,16%	6,67%	10,86%	15,42%	36,35%	58,86%		
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	26.077,82	0,01%	BRPP	3,01%	0,92%	3,16%	6,67%	10,86%	15,42%	36,35%	58,86%		
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	354.240,95	0,18%	VILA RICA	1,88%	0,92%	3,16%	6,67%	10,86%	15,42%	36,35%	58,86%		
Benchmark:	CDI				0,64%	2,26%	4,87%	8,05%	11,55%	27,32%	43,32%		
Renda Variável	37.944.924,58	18,92%											
Benchmark:	IBOVESPA				4,88%	18,11%	14,33%	23,35%	27,29%	64,88%	37,29%		
Renda Variável	37.944.924,58	18,92%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	4.951.894,58	2,47%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	32.993.030,00	16,45%	QUELUZ	100%	3,97%	14,13%	13,58%	20,93%	18,20%	42,88%	29,16%		
Benchmark:	IBOVESPA				4,88%	18,11%	14,33%	23,35%	27,29%	64,88%	37,29%		
Estruturados	4.399.816,09	2,19%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,48%	1,73%	3,44%	6,12%	8,18%	25,76%	47,20%		
FII	4.399.816,09	2,19%											
VECTOR LAJES FII	4.399.816,09	2,19%	QUELUZ	6,81%	1,97%	3,73%	4,78%	8,06%	10,31%				
Benchmark:	IFIX				6,57%	7,09%	9,30%	19,15%	22,30%	58,64%	56,30%		
Operações com Participantes*	888.684,68	0,44%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,41%	1,49%	2,96%	5,37%	7,17%	23,42%	43,10%		
Imóveis**	5.623.155,24	2,80%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,41%	1,49%	2,96%	5,37%	7,17%	23,42%	43,10%		
Total	200.576.404,14	100%											
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				0,33%	1,25%	2,47%	4,62%	6,17%	21,10%	39,08%		

* Alocação de Operações com Participantes referente à Agosto/2017.

** Alocação de Imóveis referente à Agosto/2017.

* 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.

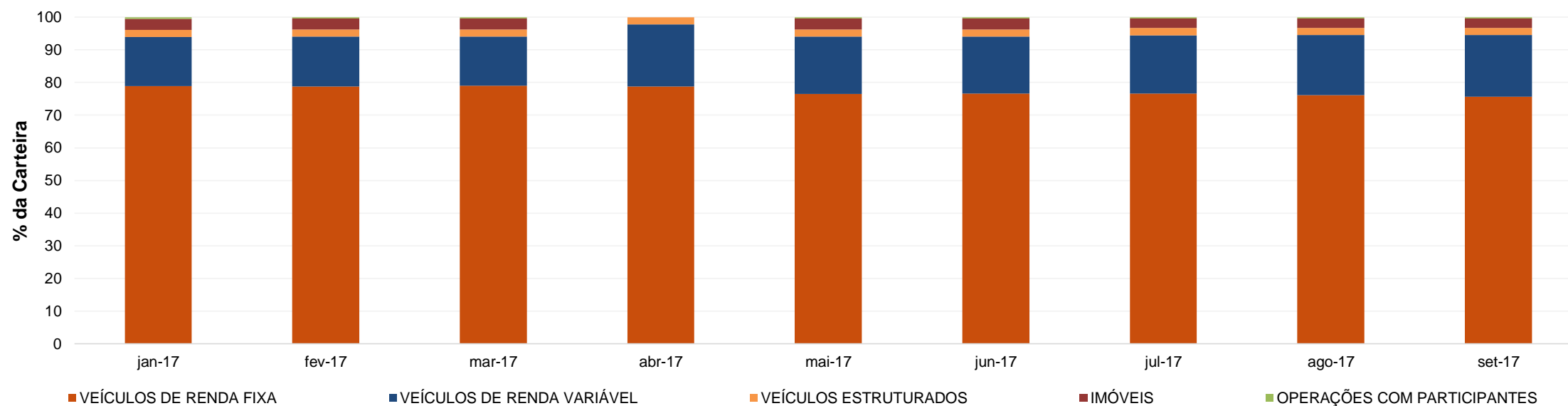
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

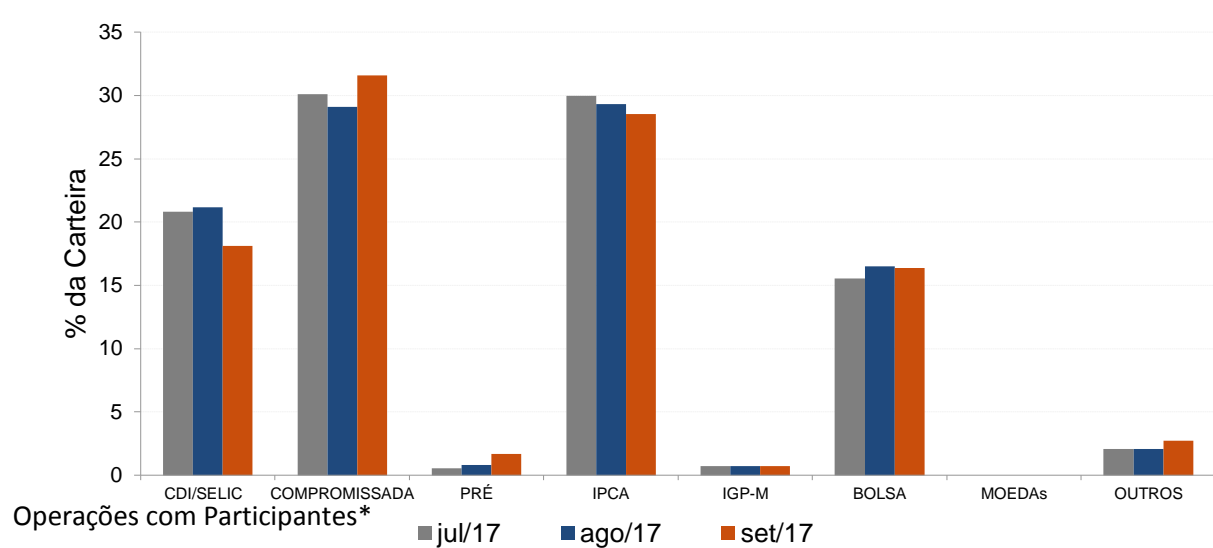
Distribuição da Carteira

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.

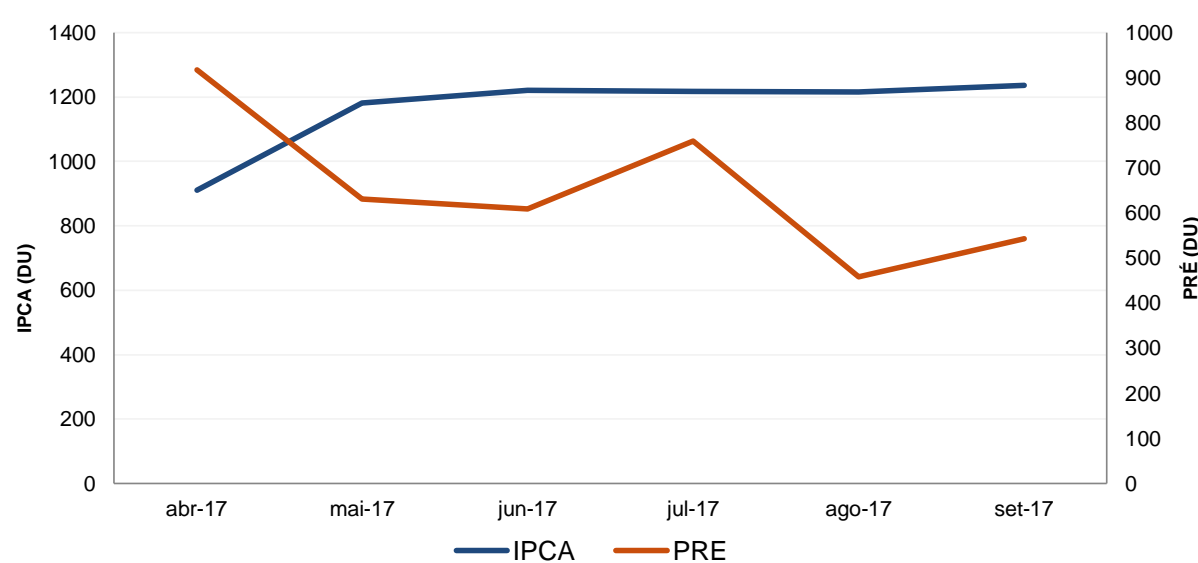
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Imóveis**

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	4.302,96	12,90	3.838,91	11,83
VIVT4	Telefonia Fixa	3.013,06	9,03	2.915,75	8,98
EQTL3	Energia Elétrica	2.958,38	8,87	2.952,10	9,09
LAME4	Comércio	2.841,30	8,52	2.622,85	8,08
BBDC4	Intermediários Financeiros	2.407,94	7,22	2.306,95	7,11
BVMF3	Serviços Financeiros Diversos	2.244,16	6,73	1.614,80	4,97
BRML3	Exploração de Imóveis	1.826,29	5,48	1.765,28	5,44
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.816,37	5,45	2.925,38	9,01
ESTC3	Diversos	1.657,97	4,97	505,88	1,56
VALE3	Mineração	1.488,65	4,46	1.638,59	5,05

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

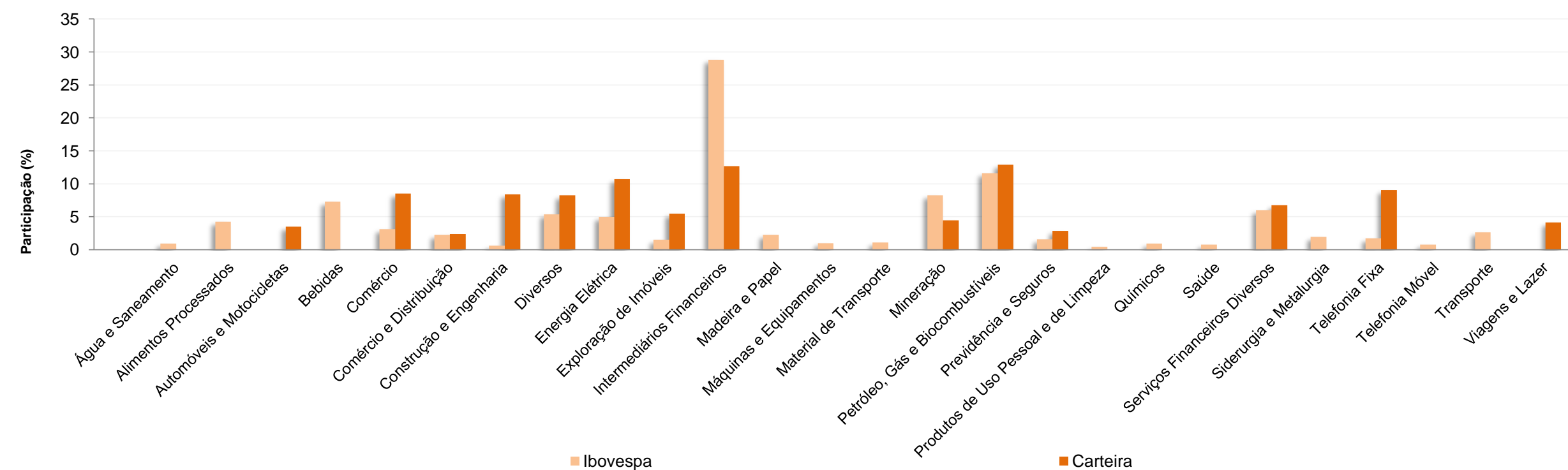
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	997,82	2,99	2,44	24
PETR4	4.302,96	12,90	0,01	1
VIVT4	3.013,06	9,03	0,01	1
EQTL3	2.958,38	8,87	0,02	1
LAME4	2.841,30	8,52	0,02	1
BBDC4	2.407,94	7,22	0,00	1
BVMF3	2.244,16	6,73	0,00	1
BRML3	1.826,29	5,48	0,02	1
ITUB4	1.816,37	5,45	0,00	1
ESTC3	1.657,97	4,97	0,02	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.



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.

Análises de Contrapartes

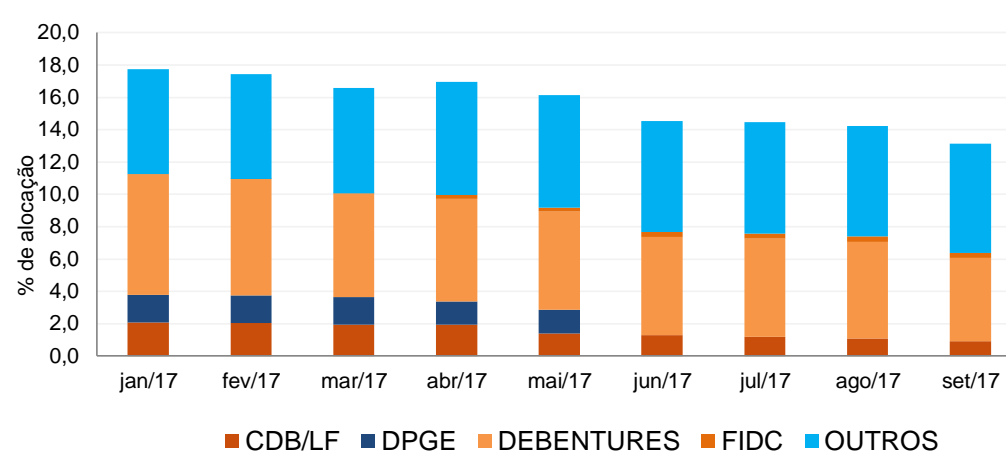
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.759,60	6,05			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	6.643,80	3,42	BBB (bra)	Ba1.br	brBBB-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	4.302,96	2,21	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
BCO BRADESCO SA	3.771,70	1,94	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
TELEFONICA BRASIL SA	3.013,06	1,55		Aaa.br	brAAA
EQUATORIAL ENERGIA SA	2.958,38	1,52			brAA-
ALGAR TELECOM S.A	2.844,59	1,46			brAA-
LOJAS AMERICANAS SA	2.841,30	1,46	AA- (bra)		
B3 S.A.- BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.244,16	1,15		Aaa.br	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1.826,29	0,94	AA+ (bra)	Aa2.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
MILS13	134,51	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS ENGENHARIA SA	Ba2.br	B2.br	Moody's	30-mai-19	CDI	116,00%	BRADESCO FI MULT FIOPREV



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/09/2017

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 2018-03-01	01-mar-18	563.267	0,29%	Selic	14-set-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	478.777	0,25%	Selic	13-set-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	329	0,00%	Selic	12-set-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	47	0,00%	Selic	12-set-17	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	32.844	0,02%	Selic	19-set-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	93.838	0,05%	Selic	19-set-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.407.508	0,72%	Selic	08-set-17	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

Operações com Participantes*

Imóveis**

