

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/12/2017

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	97.072.301,50	49,72%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,69%	2,13%	3,65%	7,61%	7,61%	20,98%	41,96%		
MM INSTITUCIONAL	51.156.188,23	26,20%											
BRADESCO FI MULT FIOPREV	51.156.188,23	26,20%	BRADESCO	100%	0,54%	1,68%	4,04%	10,32%	10,32%	25,94%	42,89%		
Benchmark:	CDI				0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%		
RF REFERENCIADO DI	27.131.061,95	13,90%											
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.131.061,95	13,90%	BRADESCO	0,51%	0,53%	1,74%	4,01%	9,90%	9,90%	24,93%	41,27%		
Benchmark:	CDI				0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%		
RF	17.950.717,71	9,19%											
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	17.950.717,71	9,19%	BB	3,12%	0,52%	1,72%	3,97%	9,78%	9,78%	24,83%	41,04%		
Benchmark:	CDI				0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%		
FIDC	834.333,61	0,43%											
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	315.745,19	0,16%	BRASIL PLURAL	0,00%	0,81%	2,61%	5,85%	13,75%	13,75%	34,20%	57,23%		
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	64.568,40	0,03%	BRPP	0,00%	0,81%	2,61%	5,85%	13,75%	13,75%	34,20%	57,23%		
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	454.020,02	0,23%	VILA RICA	1,88%	0,81%	2,61%	5,85%	13,75%	13,75%	34,20%	57,23%		
Benchmark:	CDI				0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%		
Renda Variável	33.021.805,03	16,91%											
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	2,84%	21,47%	26,86%	26,86%	76,25%	52,78%		
RV ATIVO	33.021.805,03	16,91%											
FIOPREV FIA	33.021.805,03	16,91%	QUELUZ	100%	4,27%	0,09%	14,23%	21,03%	21,03%	40,77%	29,25%		
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	2,84%	21,47%	26,86%	26,86%	76,25%	52,78%		
Estruturados	4.381.658,10	2,24%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,76%	2,36%	4,14%	8,62%	8,62%	23,26%	46,00%		
FII	4.381.658,10	2,24%											
VECTOR LAJES FII	4.381.658,10	2,24%	QUELUZ	6,84%	0,49%	-0,41%	3,30%	7,62%	7,62%	16,45%	-		
Benchmark:	IFIX				0,61%	0,25%	7,35%	19,45%	19,45%	58,02%	66,65%		
Total	195.254.667,65	100%											
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				0,61%	1,89%	3,16%	6,60%	6,60%	18,71%	37,99%		

* 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.

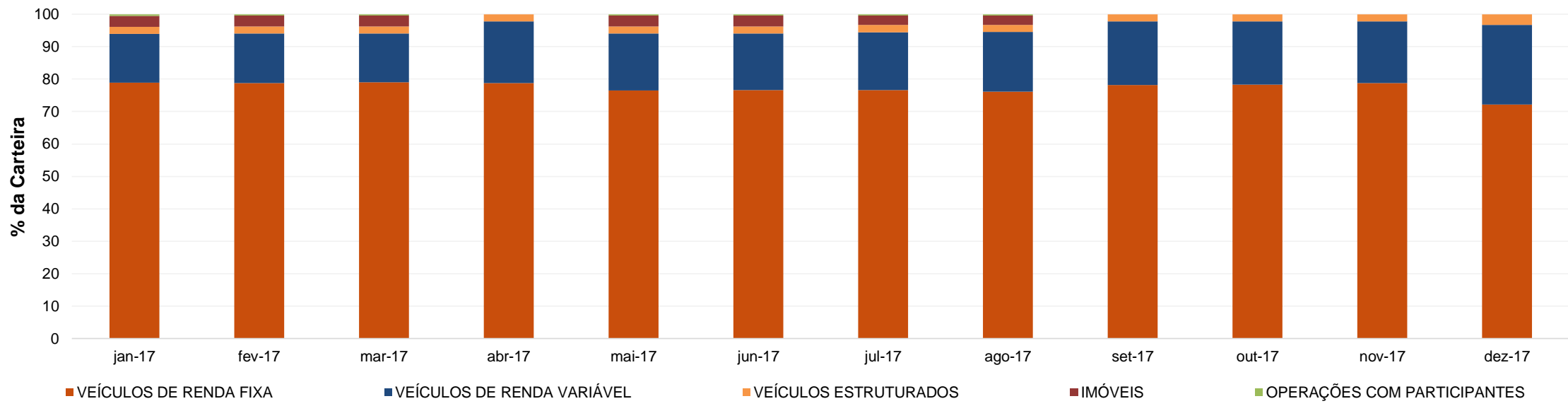
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

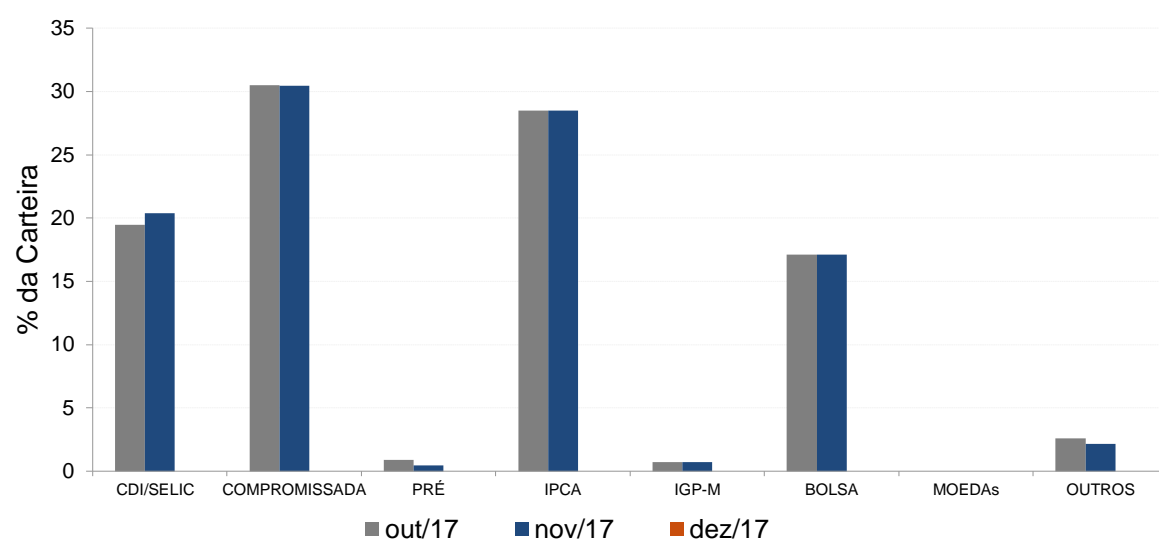
Distribuição da Carteira

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.

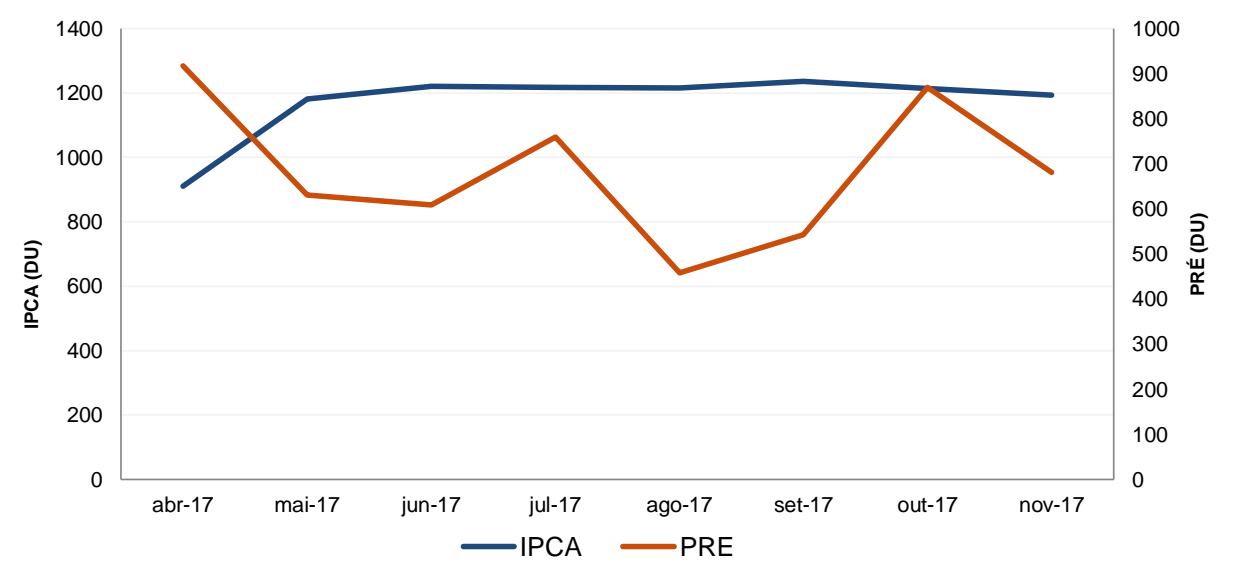
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/12/2017

Análises de Contrapartes

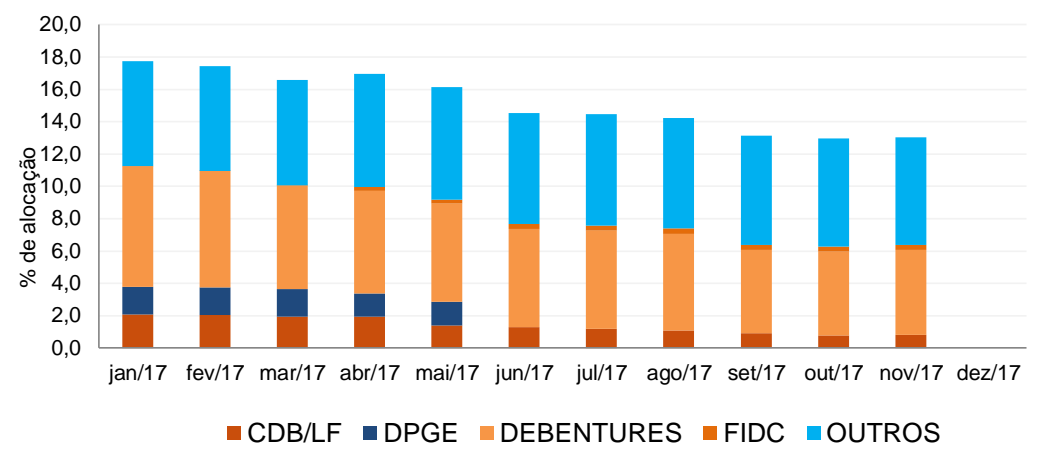
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
------	------	---	-------	---------	-----

* 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.									



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/12/2017

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.

Nenhuma operação feita no último mês.

