

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/01/2018

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*								
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M		
Renda Fixa	154,571,157.56	74.79%												
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0.70%	2.01%	3.73%	0.70%	7.41%	19.50%	40.24%		
Renda Fixa	153,718,236.34	74.38%			0.92%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	56,872,138.04	27.52%		100%	2.41%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	18,051,873.53	8.73%	BB	3.43%	0.00%	0.56%	1.64%	3.74%	0.56%	9.23%	24.24%	40.55%		
BRADESCO FI MULT FIOPREV	51,709,690.28	25.02%	BRADESCO	100%	0.09%	0.59%	1.69%	3.83%	0.59%	9.65%	25.60%	42.42%		
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27,084,534.48	13.11%	BRADESCO	0.47%	0.01%	0.57%	1.66%	3.77%	0.57%	9.35%	24.35%	40.78%		
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0.70%	2.01%	3.73%	0.70%	7.41%	19.50%	40.24%		
FIDC	852,921.22	0.41%												
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	209,883.67	0.10%	BRASIL PLURAL	3.37%		0.71%	2.43%	5.22%	1.61%	12.74%	32.88%	56.17%		
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	30,096.56	0.01%	BRPP	3.25%		0.71%	2.43%	5.22%	1.61%	12.74%	32.88%	56.17%		
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	612,940.99	0.30%	VILA RICA	1.88%		0.71%	2.43%	5.22%	1.61%	12.74%	32.88%	56.17%		
Benchmark:	CDI					0.58%	1.70%	3.84%	0.58%	9.40%	24.76%	41.44%		
Renda Variável	41,400,220.31	20.03%												
Benchmark:	IBOVESPA					11.14%	14.27%	28.81%	11.14%	31.30%	110.15%	81.02%		
Renda Variável	41,400,220.31	20.03%												
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	5,916,037.11	2.86%		100%		-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	35,484,183.20	17.17%	QUELUZ	100%		7.46%	8.86%	17.68%	7.46%	23.59%	51.74%	47.79%		
Benchmark:	IBOVESPA					11.14%	14.27%	28.81%	11.14%	31.30%	110.15%	81.02%		
Estruturados	4,415,627.87	2.14%												
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0.78%	2.24%	4.22%	0.78%	8.41%	21.77%	44.24%		
FII	4,415,627.87	2.14%												
VECTOR LAJES FII	4,415,627.87	2.14%	QUELUZ	6.81%		0.40%	1.68%	2.75%	1.18%	6.58%	15.16%	-		
Benchmark:	IFIX					2.64%	2.66%	10.61%	2.64%	18.16%	72.86%	66.56%		
Operações com Participantes	707,285.88	0.34%												
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0.78%	2.24%	4.22%	0.78%	8.41%	21.77%	44.24%		
Imóveis	5,576,271.43	2.70%												
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0.78%	2.24%	4.22%	0.78%	8.41%	21.77%	44.24%		
Total	206,670,563.05	100%			2.13%									
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0.70%	2.01%	3.73%	0.70%	7.41%	19.50%	40.24%		

* 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.

Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

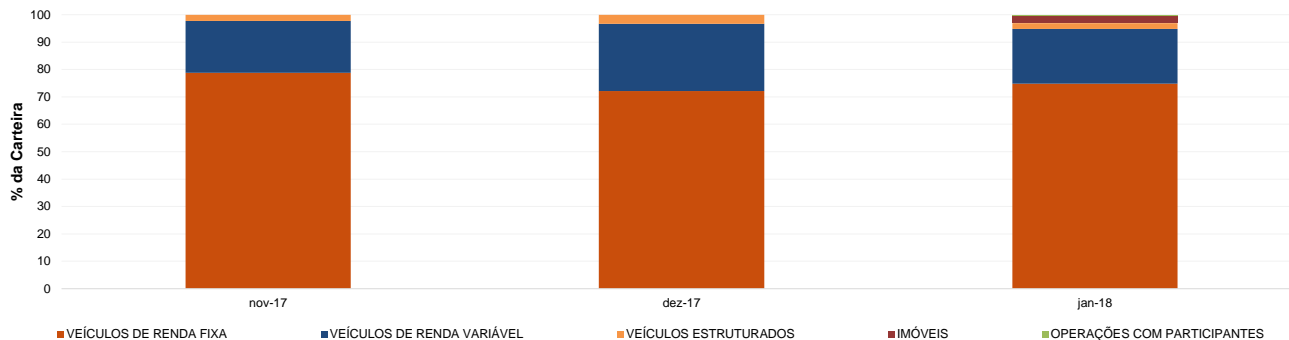
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

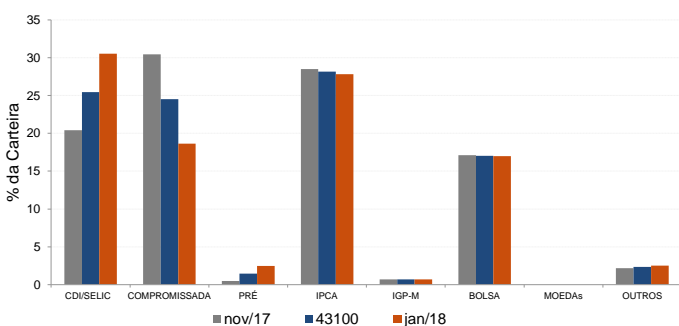
Distribuição da Carteira

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.

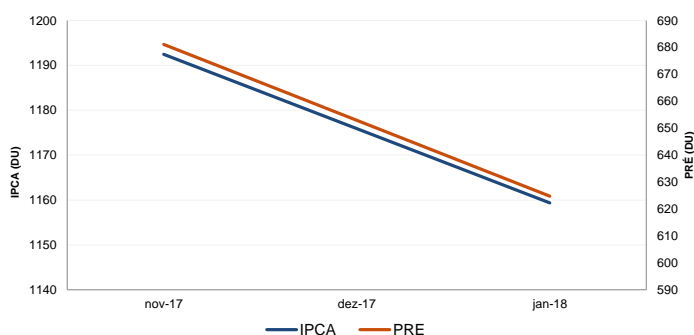
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de 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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4,368.26	12.81	0.00	
EQTL3	Energia Elétrica	3,199.00	9.38	0.00	
BBDC4	Intermediários Financeiros	2,408.33	7.06	0.00	
VALE3	Mineração	1,936.13	5.68	0.00	
LAME4	Comércio	1,918.15	5.63	0.00	
IRBR3	Previdência e Seguros	1,873.75	5.50	0.00	
ITSA4	Intermediários Financeiros	1,827.18	5.36	0.00	
CVCB3	Viagens e Lazer	1,692.49	4.96	0.00	
ENGI11	Energia Elétrica	1,595.15	4.68	0.00	
BRML3	Exploração de Imóveis	1,450.77	4.25	0.00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

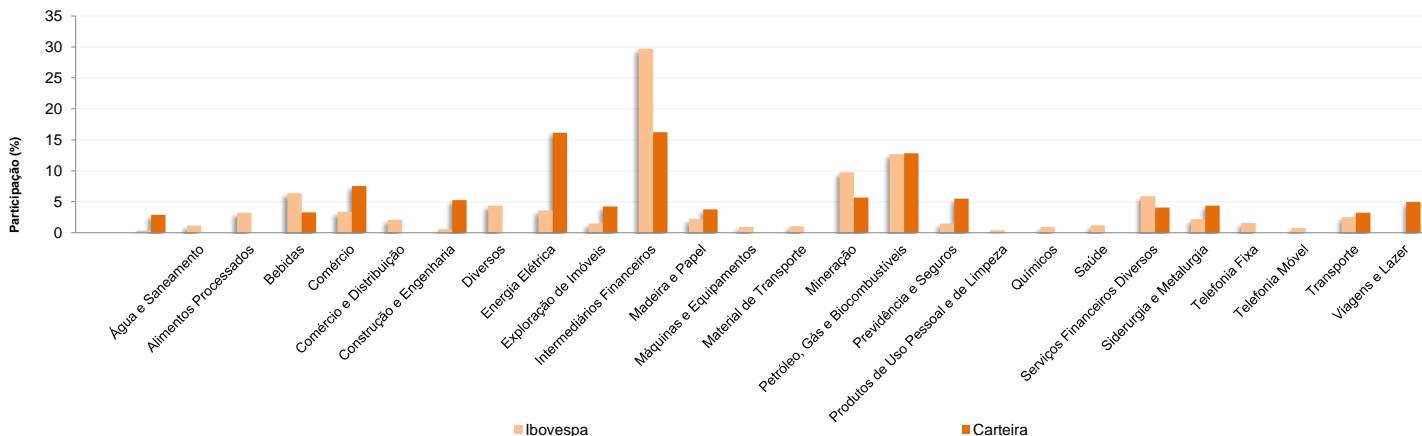
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	805.47	2.36	2.44	294
PETR4	4,368.26	12.81	0.01	1
EQTL3	3,199.00	9.38	0.02	1
BBDC4	2,408.33	7.06	0.00	1
VALE3	1,936.13	5.68	0.00	1
LAME4	1,918.15	5.63	0.02	1
IRBR3	1,873.75	5.50	0.05	1
ITSA4	1,827.18	5.36	0.00	1
CVCB3	1,692.49	4.96	0.02	1
ENGI11	1,595.15	4.68	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.



Este 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

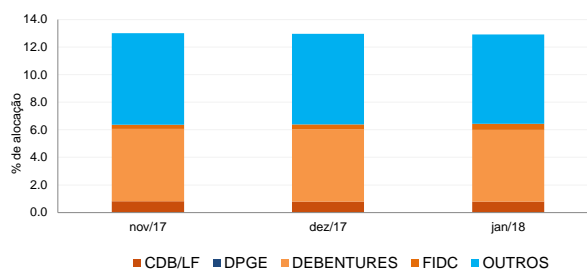
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11,599.59	5.78			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	7,054.53	3.52	BB- (bra)	B2.br	brBBB-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	4,368.26	2.18	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
BCO BRADESCO SA	3,813.31	1.90	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
EQUATORIAL ENERGIA SA	3,199.00	1.59			brAA-
ALGAR TELECOM S.A	2,928.46	1.46			brAA-
LOJAS AMERICANAS SA	2,569.15	1.28	AA- (bra)		
VALE SA	1,936.13	0.97	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,873.75	0.93			
ITAUSA INVESTS ITAU SA	1,829.46	0.91		A1.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.									

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/01/2018

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	880,636	0.44%	Selic	05-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	762,927	0.38%	Selic	16-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	959,108	0.48%	Selic	09-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	336,124	0.17%	Selic	02-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	34,000	0.02%	Selic	12-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	91,102	0.05%	Selic	12-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	115,945	0.06%	Selic	12-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	48,819	0.02%	Selic	12-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	47,510	0.02%	Selic	12-jan-18	0.00%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	157,079	0.08%	Selic	19-jan-18	0.01%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	128,488	0.06%	Selic	19-jan-18	0.01%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	128,488	0.06%	Selic	19-jan-18	0.01%	0.00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

