

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 28/02/2018

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	155.098.973,88	74,61%										
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,56%	1,96%	3,84%	1,27%	7,34%	18,56%	38,88%	
Renda Fixa	154.571.488,90	74,35%		0,55%								
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	55.745.476,30	26,82%		100%	1,47%	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	19.634.546,35	9,44%	BB	3,65%	0,00%	0,44%	1,54%	3,39%	1,01%	8,79%	23,58%	40,05%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	51.985.767,87	25,01%	BRADESCO	100%	0,07%	0,53%	1,67%	3,49%	1,13%	9,13%	25,09%	41,73%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.205.698,38	13,09%	BRADESCO	0,46%	0,01%	0,45%	1,55%	3,42%	1,02%	8,91%	23,70%	40,27%
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,56%	1,96%	3,84%	1,27%	7,34%	18,56%	38,88%	
FIDC	527.484,99	0,25%										
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	207.355,28	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%	0,71%	2,43%	5,22%	1,61%	12,74%	32,88%	56,17%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	27.938,45	0,01%	BRPP	3,01%	0,71%	2,43%	5,22%	1,61%	12,74%	32,88%	56,17%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	292.191,26	0,14%	VILA RICA	1,88%	0,71%	2,43%	5,22%	1,61%	12,74%	32,88%	56,17%	
Benchmark:	CDI				0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%	
Renda Variável	42.101.021,59	20,25%										
Benchmark:	IBOVESPA				0,52%	18,60%	20,50%	11,72%	28,04%	99,46%	65,47%	
Renda Variável	42.101.021,59	20,25%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.247.578,45	3,01%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	35.853.443,14	17,25%	QUELUZ	100%	1,04%	13,21%	12,99%	8,58%	20,84%	52,02%	42,64%	
Benchmark:	IBOVESPA				0,52%	18,60%	20,50%	11,72%	28,04%	99,46%	65,47%	
Estruturado	4.433.376,00	2,13%										
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,63%	2,19%	4,31%	1,42%	8,35%	20,81%	42,84%	
FII	4.433.376,00	2,13%										
VECTOR LAJES FII	4.433.376,00	2,13%	QUELUZ	6,81%	0,40%	1,68%	2,75%	1,18%	6,58%	15,16%		
Benchmark:	IFIX				1,15%	4,45%	10,91%	3,82%	13,97%	69,83%	68,84%	
Operações com Participantes	684.198,27	0,33%										
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,63%	2,19%	4,31%	1,42%	8,35%	20,81%	42,84%	
Imóveis	5.569.816,67	2,68%										
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,63%	2,19%	4,31%	1,42%	8,35%	20,81%	42,84%	
Total	207.883.471,24	100%			1,57%							
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,56%	1,96%	3,84%	1,27%	7,34%	18,56%	38,88%	

* 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.

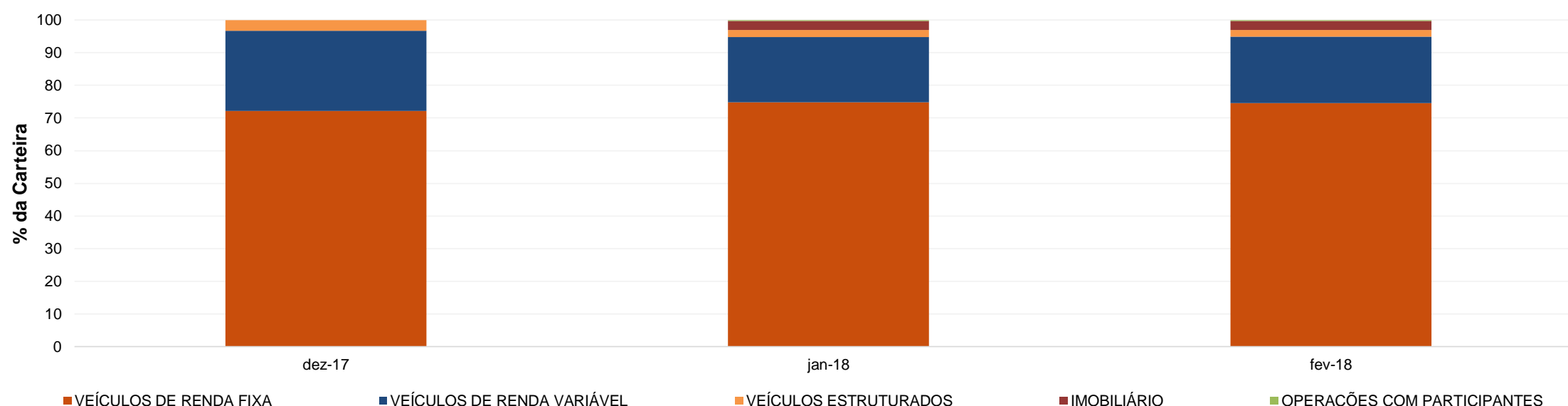
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

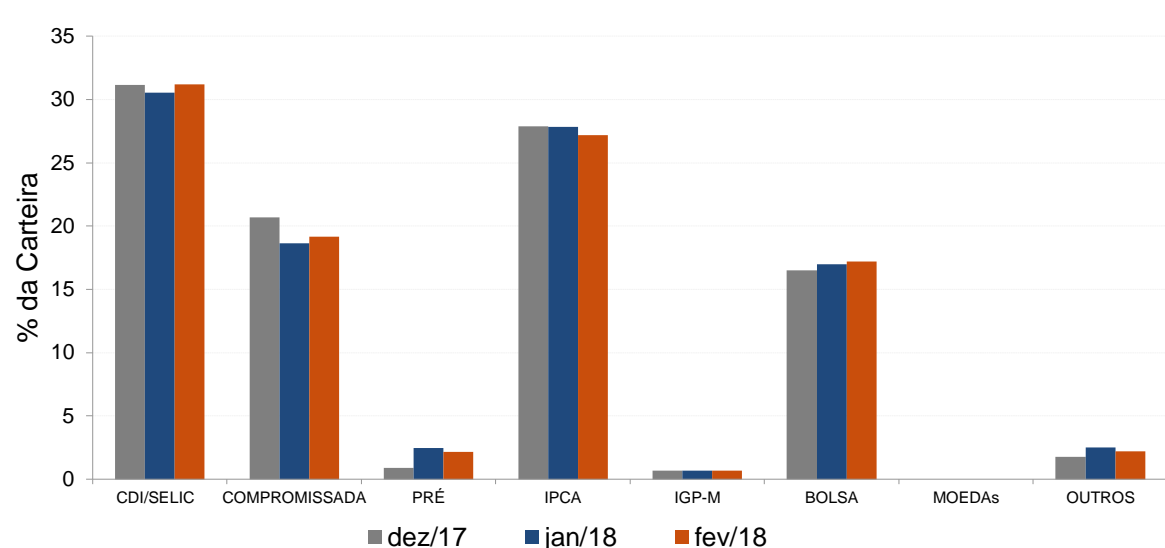
Distribuição da Carteira

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.

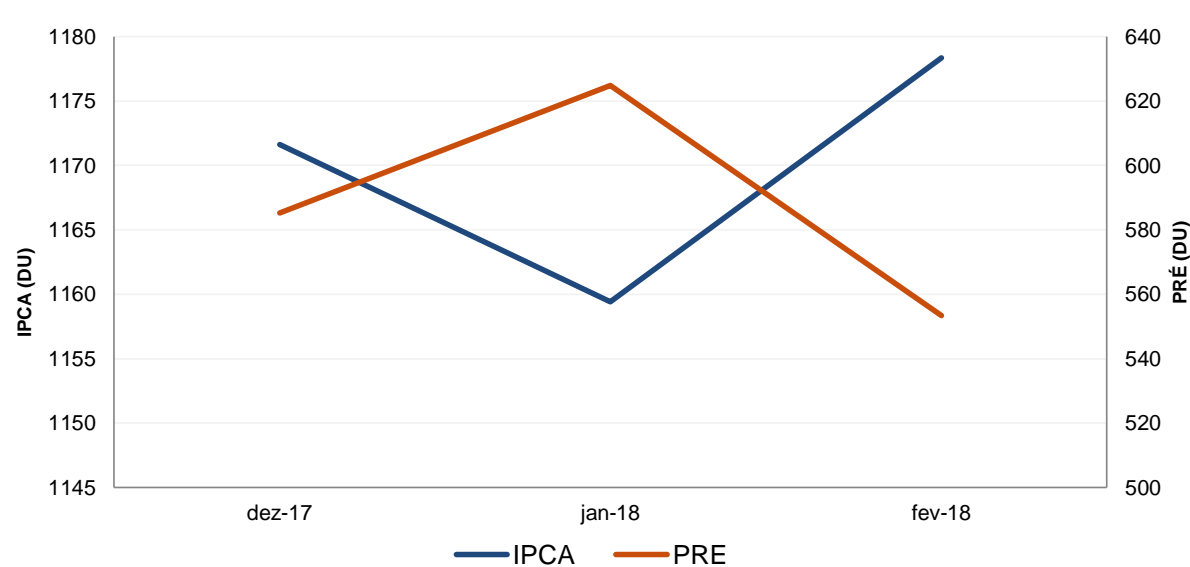
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



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	5.144,80	14,82	4.368,26	12,81
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.294,85	9,49	1.296,05	3,80
EQTL3	Energia Elétrica	3.272,12	9,42	3.199,00	9,38
ENGI11	Energia Elétrica	2.451,90	7,06	1.595,15	4,68
IRBR3	Previdência e Seguros	2.283,30	6,58	1.873,75	5,50
VALE3	Mineração	2.104,29	6,06	1.936,13	5,68
ITSA4	Intermediários Financeiros	1.790,88	5,16	1.827,18	5,36
CVCB3	Viagens e Lazer	1.723,50	4,96	1.692,49	4,96
LAME4	Comércio	1.544,52	4,45	1.918,15	5,63
MRVE3	Construção e Engenharia	1.343,43	3,87	987,78	2,90

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

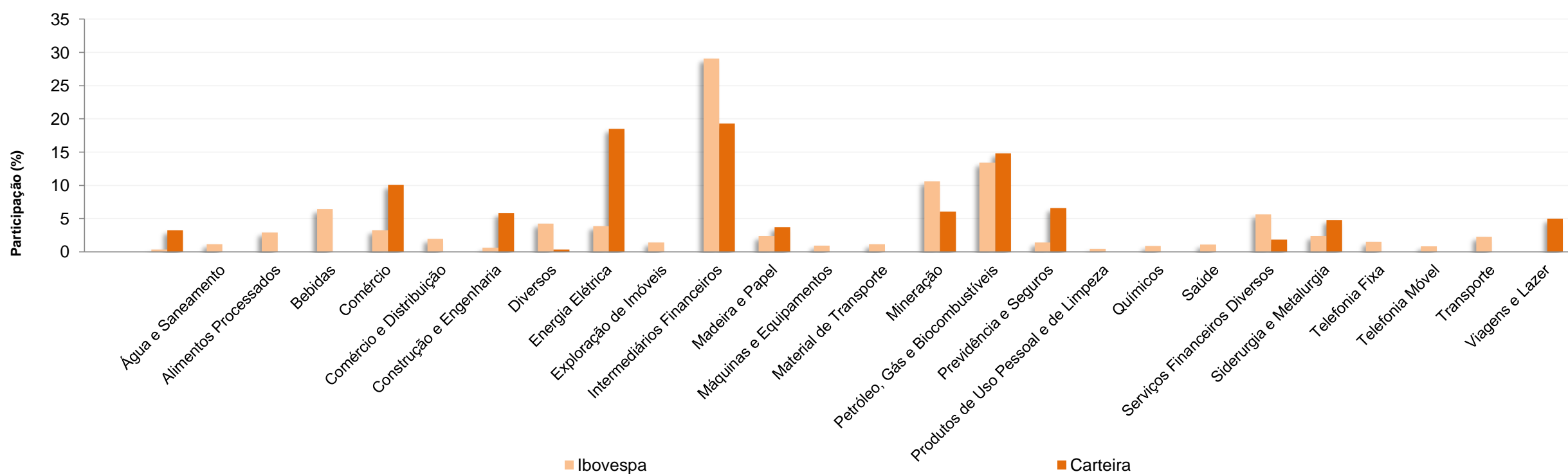
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SMLE3	111,38	0,32	0,00	Sem Liquidez
JFEN3	685,25	1,97	2,44	212
PETR4	5.144,80	14,82	0,01	1
ITUB4	3.294,85	9,49	0,00	1
EQTL3	3.272,12	9,42	0,02	1
ENGI11	2.451,90	7,06	0,03	1
IRBR3	2.283,30	6,58	0,06	1
VALE3	2.104,29	6,06	0,00	1
ITSA4	1.790,88	5,16	0,00	1
CVCB3	1.723,50	4,96	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.



Análises de Contrapartes

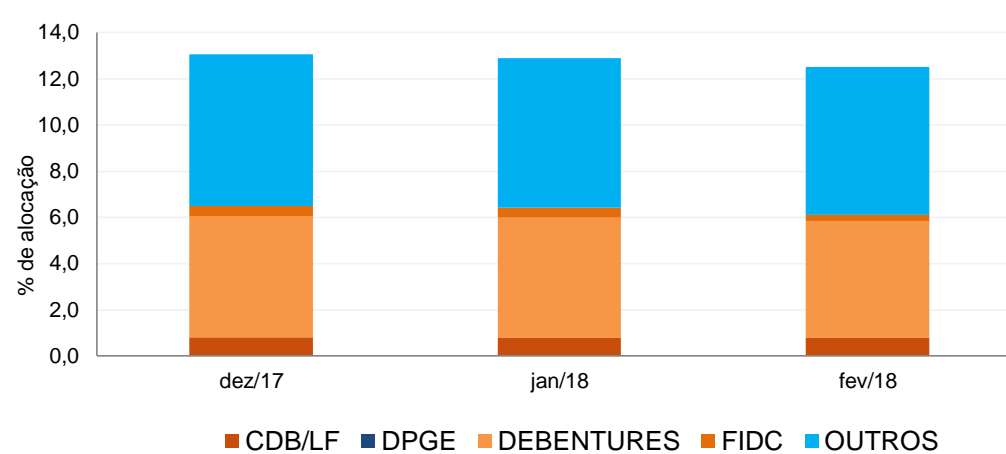
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.530,13	5,71			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	6.777,02	3,36	BB- (bra)	B2.br	brBBB-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5.144,80	2,55	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.294,85	1,63	AAA (bra)	A1.br	brAA-
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.272,12	1,62			brAA-
ALGAR TELECOM S.A	2.945,31	1,46			brAA-
ENERGISA SA	2.451,90	1,21	AA (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO BRADESCO SA	2.301,35	1,14	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2.283,30	1,13			
LOJAS AMERICANAS SA	2.194,52	1,09	AA- (bra)		

* 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: 28/02/2018

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 2018-09-01	01-set-18	647.500	0,32%	Selic	22-fev-18	0,00%	0,00%	BRANDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	64.750	0,03%	Selic	21-fev-18	0,00%	0,00%	BRANDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	431.574	0,21%	Selic	15-fev-18	0,00%	0,00%	BRANDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	215.743	0,11%	Selic	16-fev-18	0,01%	0,01%	BRANDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	140.179	0,07%	IPCA	28-fev-18	5,07%	5,09%	BRANDESCO FI MULT FIOPREV

