

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/03/2018

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	156.388.011,20	74,43%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0,52%	1,79%	3,96%	1,79%	7,03%	18,10%	36,88%	
Renda Fixa	155.876.294,78	74,19%		0,43%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	56.699.016,48	26,98%		100%	1,11%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	19.735.502,41	9,39%	BB	3,68%	0,00%	0,51%	1,53%	3,27%	1,53%	8,23%	22,83%	39,35%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	52.295.351,93	24,89%	BRADESCO	100%	0,08%	0,60%	1,73%	3,44%	1,73%	8,60%	24,41%	40,89%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.146.423,96	12,92%	BRADESCO	0,45%	0,00%	0,52%	1,54%	3,30%	1,54%	8,35%	22,97%	39,57%	
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0,52%	1,79%	3,96%	1,79%	7,03%	18,10%	36,88%	
FIDC	511.716,42	0,24%											
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	206.710,87	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,82%	2,44%	5,12%	2,44%	12,13%	32,04%	55,37%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	27.607,93	0,01%	BRPP	3,01%		0,82%	2,44%	5,12%	2,44%	12,13%	32,04%	55,37%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	277.397,62	0,13%	VILA RICA	1,88%		0,82%	2,44%	5,12%	2,44%	12,13%	32,04%	55,37%	
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%	
Renda Variável	43.001.725,32	20,47%											
Benchmark:	IBOVESPA					0,01%	11,73%	14,90%	11,73%	31,36%	70,54%	66,89%	
Renda Variável	43.001.725,32	20,47%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.203.040,54	2,95%		100%		-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	36.798.684,78	17,51%	QUELUZ	100%		2,64%	11,44%	11,53%	11,44%	26,68%	46,81%	43,50%	
Benchmark:	IBOVESPA					0,01%	11,73%	14,90%	11,73%	31,36%	70,54%	66,89%	
Estruturado	4.477.918,26	2,13%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0,60%	2,02%	4,43%	2,02%	8,03%	20,33%	40,78%	
FII	4.477.918,26	2,13%											
VECTOR LAJES FII	4.477.918,26	2,13%	QUELUZ	6,81%		1,00%	2,20%	1,78%	2,20%	6,64%	15,55%	-	
Benchmark:	IFIX					2,00%	5,89%	6,15%	5,89%	16,02%	58,76%	75,02%	
Operações com Participantes **	684.198,27	0,33%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0,60%	2,02%	4,43%	2,02%	8,03%	20,33%	40,78%	
Imóveis **	5.569.816,67	2,65%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.					0,60%	2,02%	4,43%	2,02%	8,03%	20,33%	40,78%	
Total	210.117.529,13	100%			1,32%								
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.					0,52%	1,79%	3,96%	1,79%	7,03%	18,10%	36,88%	

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 28/02/2018

* 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.

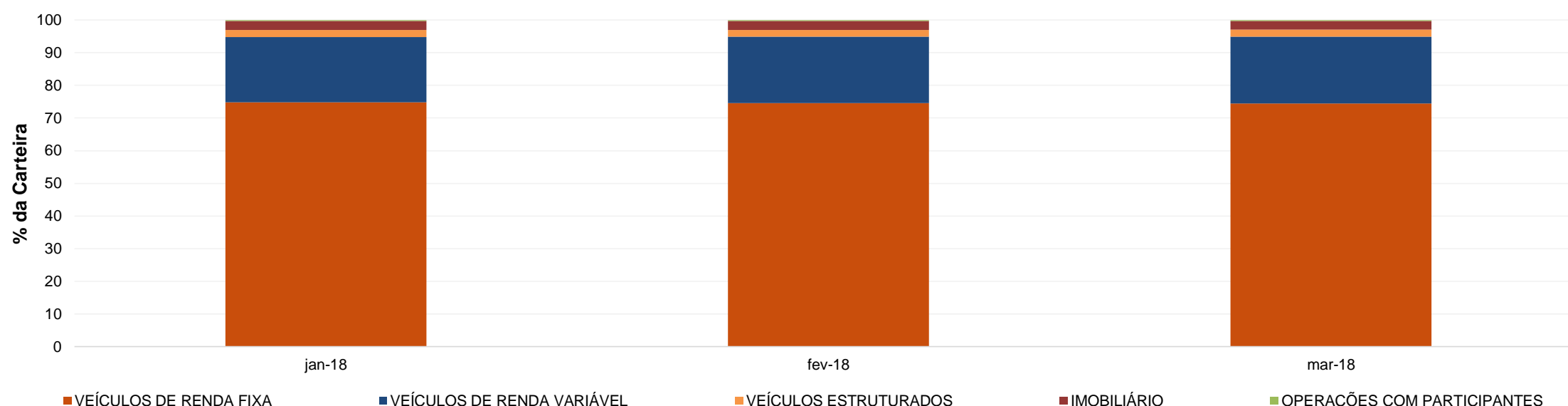
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

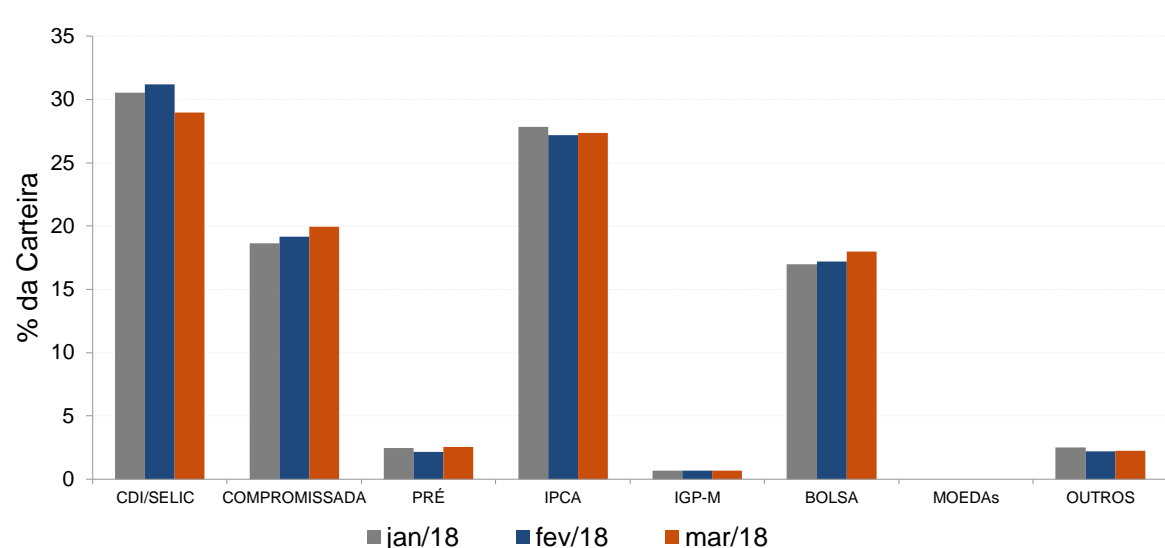
Distribuição da Carteira

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.

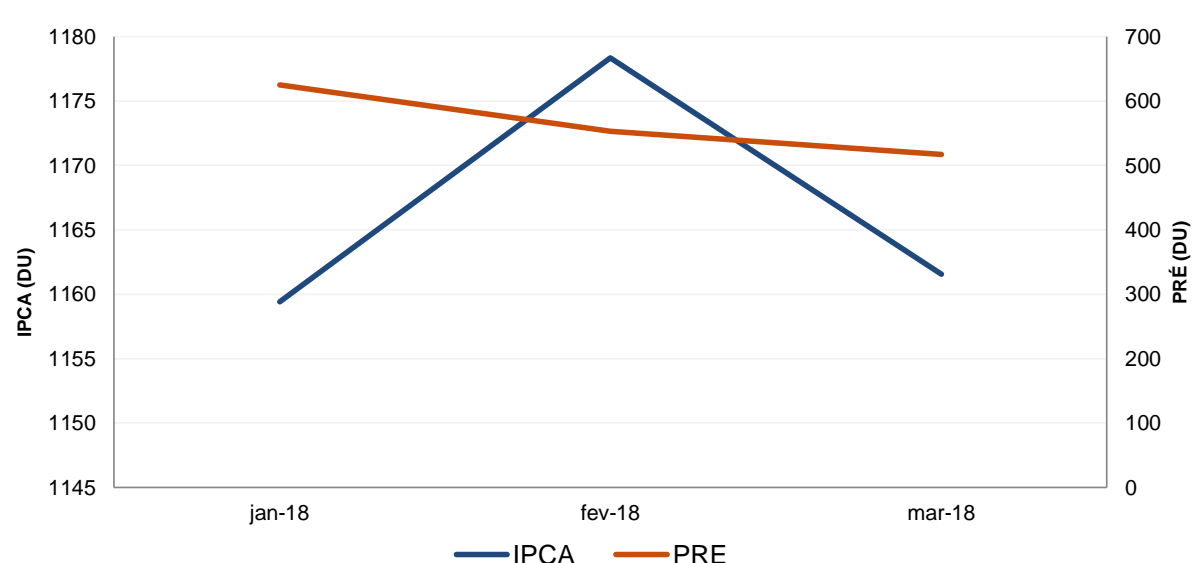
Evolução do Patrimônio Líquido



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	5.132,81	13,96	5.144,80	14,82
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.355,67	9,13	3.294,85	9,49
EQTL3	Energia Elétrica	3.267,55	8,89	3.272,12	9,42
ENGI11	Energia Elétrica	2.578,21	7,01	2.451,90	7,06
IRBR3	Previdência e Seguros	2.469,74	6,72	2.283,30	6,58
LREN3	Comércio	2.012,91	5,48	1.294,50	3,73
VALE3	Mineração	1.971,63	5,36	2.104,29	6,06
ITSA4	Intermediários Financeiros	1.882,34	5,12	1.790,88	5,16
MRVE3	Construção e Engenharia	1.634,75	4,45	1.343,43	3,87
MULT3	Exploração de Imóveis	1.620,85	4,41	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

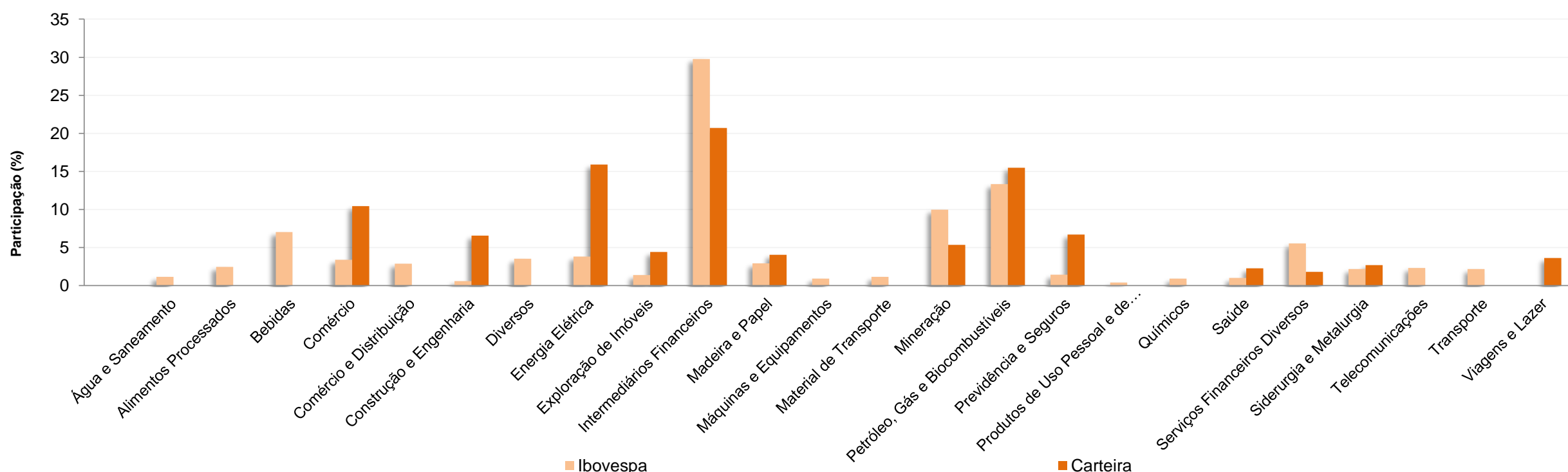
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	781,43	2,13	2,44	11
PETR4	5.132,81	13,96	0,01	1
ITUB4	3.355,67	9,13	0,00	1
EQTL3	3.267,55	8,89	0,02	1
ENGI11	2.578,21	7,01	0,03	1
IRBR3	2.469,74	6,72	0,06	1
LREN3	2.012,91	5,48	0,01	1
VALE3	1.971,63	5,36	0,00	1
ITSA4	1.882,34	5,12	0,00	1
MRVE3	1.634,75	4,45	0,03	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

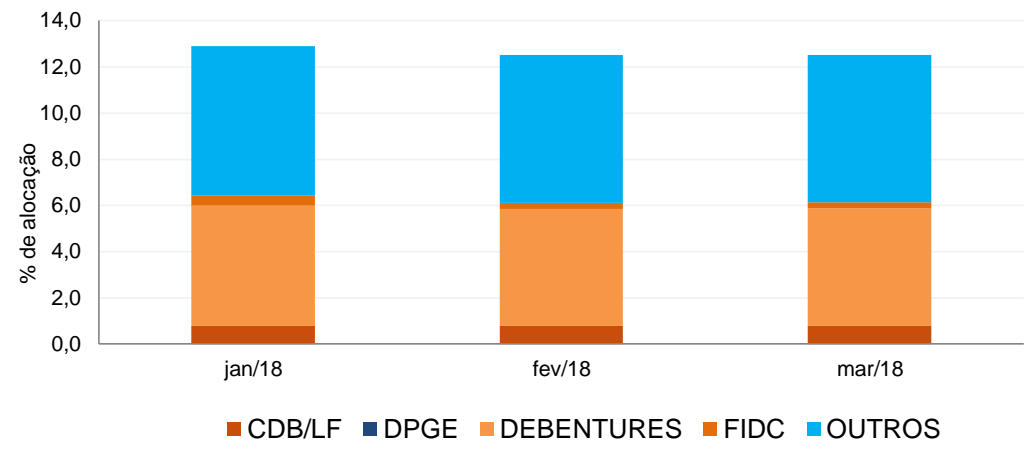
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.607,23	5,68			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	6.961,17	3,41	BB- (bra)	B2.br	brBBB
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5.132,81	2,51	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.355,67	1,64	AAA (bra)	A1.br	brAA-
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.267,55	1,60			brAA-
ALGAR TELECOM S.A	2.974,95	1,46			brAA-
BCO BRADESCO SA	2.695,27	1,32	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
ENERGISA SA	2.578,21	1,26	AA (bra)	Aa2.br	brAA-
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2.469,74	1,21			
LOJAS RENNEN SA	2.012,91	0,99			brAAA

* 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: 29/03/2018

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	1.208.168	0,59%	Selic	01-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	128.061	0,06%	Selic	08-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	640.253	0,31%	Selic	01-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

