

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/05/2018

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	155.320.862,40	73,86%											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,88%	2,07%	4,07%	3,36%	7,29%	16,98%	35,51%		
Renda Fixa	154.908.971,23	73,66%		1,15%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	55.074.420,20	26,19%		100%	3,09%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	19.930.783,00	9,48%	BB	3,73%	0,01%	0,49%	1,51%	3,07%	2,53%	7,48%	21,45%	38,10%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	52.727.865,78	25,07%	BRADESCO	100%	0,14%	0,33%	1,43%	3,12%	2,57%	7,56%	22,62%	39,11%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.175.902,25	12,92%	BRADESCO	0,41%	0,01%	0,49%	1,52%	3,09%	2,55%	7,59%	21,61%	38,31%	
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,88%	2,07%	4,07%	3,36%	7,29%	16,98%	35,51%		
FIDC	411.891,17	0,20%											
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	205.629,34	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%	0,81%	2,45%	4,95%	4,10%	11,41%	30,59%	54,04%		
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	27.029,56	0,01%	BRPP	3,01%	0,81%	2,45%	4,95%	4,10%	11,41%	30,59%	54,04%		
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	179.232,26	0,09%	VILA RICA	1,88%	0,81%	2,45%	4,95%	4,10%	11,41%	30,59%	54,04%		
Benchmark:	CDI				0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%		
Renda Variável	39.839.887,17	18,94%											
Benchmark:	IBOVESPA				-10,87%	-10,08%	6,65%	0,46%	22,39%	58,35%	45,48%		
Renda Variável	39.839.887,17	18,94%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	5.874.167,90	2,79%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	33.965.719,27	16,15%	QUELUZ	100%	-8,37%	-5,27%	7,25%	2,86%	18,91%	34,28%	32,18%		
Benchmark:	IBOVESPA				-10,87%	-10,08%	6,65%	0,46%	22,39%	58,35%	45,48%		
Imobiliário **	10.010.528,55	4,76%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,96%	2,31%	4,55%	3,76%	8,30%	19,20%	39,38%		
Imóveis	5.556.907,14	2,64%											
FII	4.453.621,41	2,12%											
VECTOR LAJES FII	4.453.621,41	2,12%	QUELUZ	6,81%	-0,86%	0,46%	2,14%	1,64%	5,51%	12,76%	-		
Benchmark:	IFIX				-5,27%	-4,21%	0,05%	-0,55%	7,69%	37,35%	56,25%		
Operações com Participantes **	676.926,90	0,32%											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				0,96%	2,31%	4,55%	3,76%	8,30%	19,20%	39,38%		
Total	210.297.545,80	100%			2,16%								
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				0,88%	2,07%	4,07%	3,36%	7,29%	16,98%	35,51%		

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 30/04/2018

* 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.

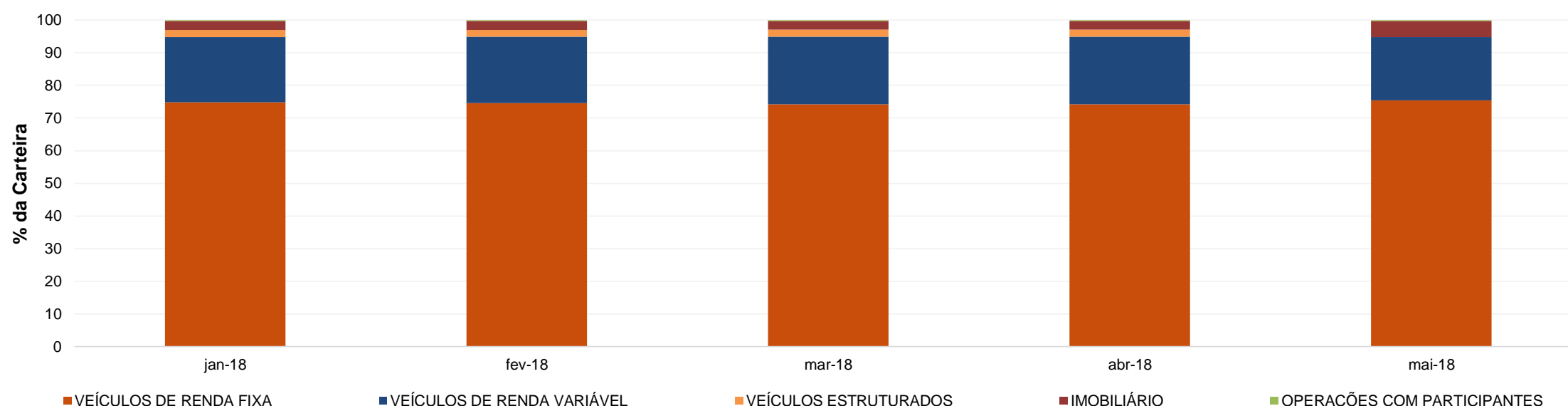
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

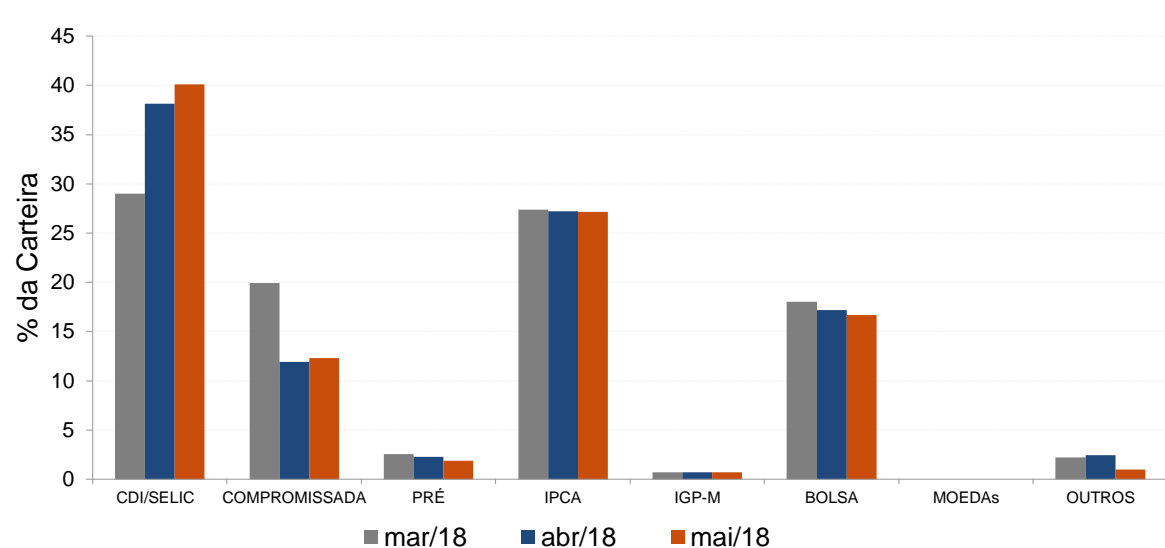
Distribuição da Carteira

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.

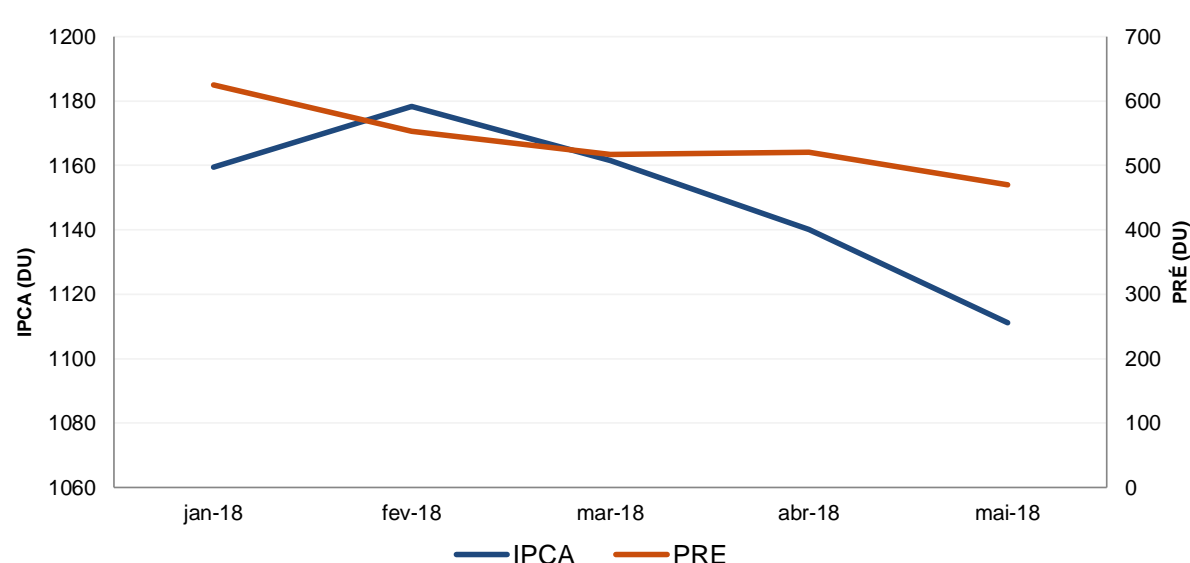
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	3.357,28	10,07	2.273,38	6,45
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.339,55	10,02	3.336,05	9,47
EQTL3	Energia Elétrica	3.276,58	9,83	3.251,56	9,23
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.058,42	9,17	5.897,29	16,73
LREN3	Comércio	2.266,79	6,80	1.910,95	5,42
SUZB3	Madeira e Papel	2.159,31	6,48	693,91	1,97
CVCB3	Viagens e Lazer	2.096,10	6,29	730,67	2,07
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.970,23	5,91	981,69	2,79
MULT3	Exploração de Imóveis	1.631,03	4,89	2.654,15	7,53
RENT3	Diversos	1.622,29	4,87	864,59	2,45

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

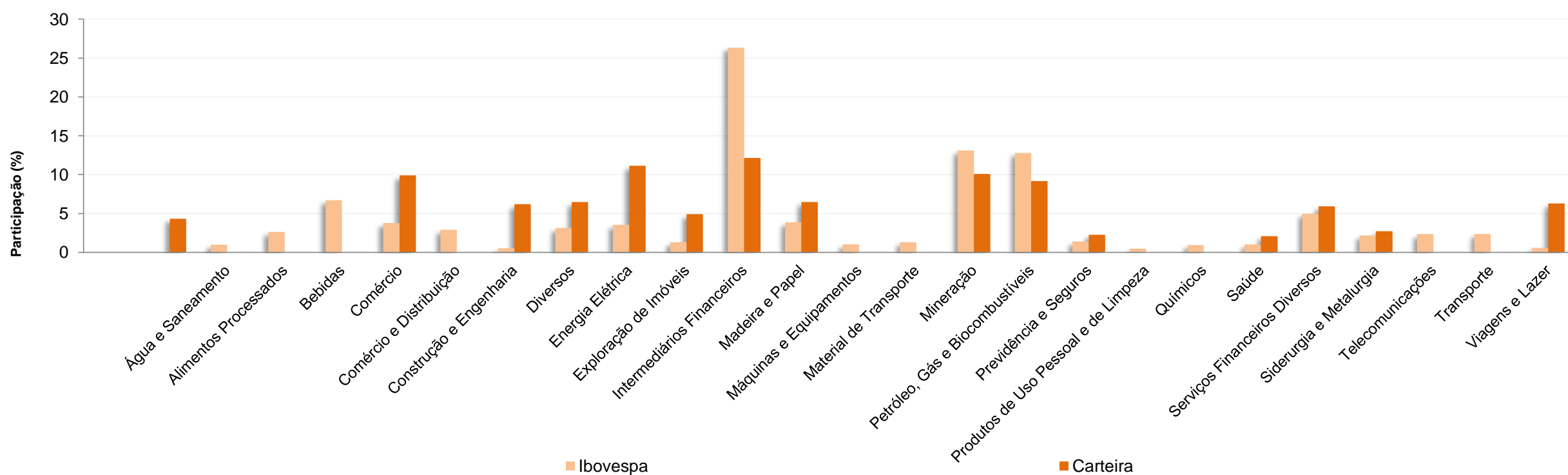
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	450,82	1,35	0,24	125
VALE3	3.357,28	10,07	0,00	1
ITUB4	3.339,55	10,02	0,00	1
EQTL3	3.276,58	9,83	0,03	1
PETR4	3.058,42	9,17	0,00	1
LREN3	2.266,79	6,80	0,01	1
SUZB3	2.159,31	6,48	0,01	1
CVCB3	2.096,10	6,29	0,03	1
B3SA3	1.970,23	5,91	0,00	1
MULT3	1.631,03	4,89	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.



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

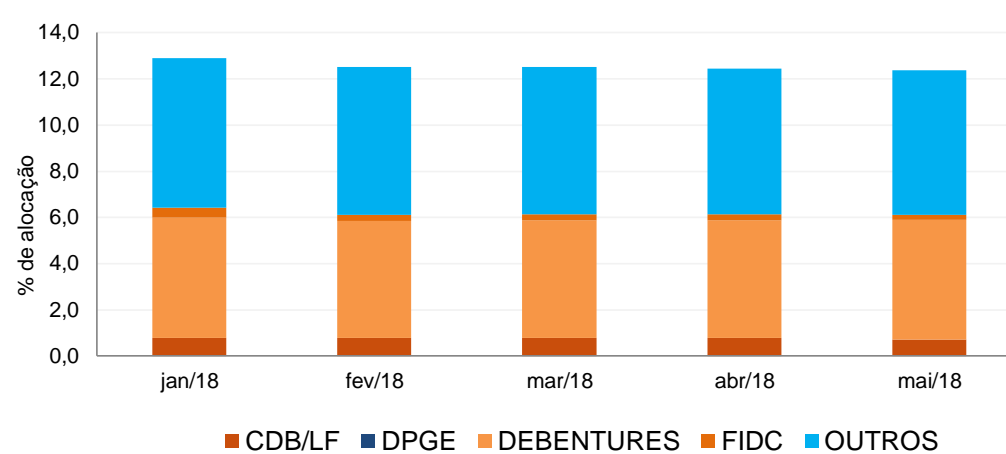
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.097,86	5,55			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	7.010,26	3,51	BBB- (bra)	B2.br	brBBB
VALE SA	3.357,28	1,68	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.339,55	1,67	AAA (bra)	A1.br	brAA-
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.276,58	1,64			brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	3.058,42	1,53	AA (bra)	Aaa.br	brA+
ALGAR TELECOM S.A	3.000,91	1,50			brAA-
LOJAS RENNEN SA	2.266,79	1,13			brAAA
SUZANO PAPEL CELULOSE SA	2.159,31	1,08	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO BRADESCO SA	2.096,26	1,05	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-

* 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
CMTR33	7.010,26	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	BB- (bra)	BBB- (bra)	Fitch	15-fev-22	IPCA	6,19%	FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROP



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/05/2018

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	77.253	0,04%	Selic	16-mai-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	192.986	0,10%	Selic	15-mai-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	347.323	0,17%	Selic	15-mai-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

