

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/06/2018

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		
<b>Renda Fixa</b>	<b>155.558.418,09</b>	<b>76,80%</b>											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				1,88%	3,46%	5,31%	5,31%	9,15%	18,07%	36,39%		
<b>Renda Fixa</b>	<b>155.165.829,05</b>	<b>76,60%</b>		<b>1,06%</b>									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	55.096.970,04	27,20%		100%	2,89%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	20.030.264,18	9,89%	BB	4,02%	0,01%	0,50%	1,49%	3,05%	3,05%	7,14%	20,69%	37,35%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	52.726.150,36	26,03%	BRADESCO	100%	0,09%	0,41%	1,25%	3,00%	3,00%	7,15%	21,64%	38,50%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.312.444,47	13,48%	BRADESCO	0,39%	0,01%	0,50%	1,50%	3,07%	3,07%	7,21%	20,84%	37,55%	
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				1,88%	3,46%	5,31%	5,31%	9,15%	18,07%	36,39%		
<b>FIDC</b>	<b>392.589,05</b>	<b>0,19%</b>											
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	202.222,92	0,10%	BRASIL PLURAL	3,33%	0,81%	2,44%	4,94%	4,94%	11,08%	29,74%	53,21%		
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	26.410,08	0,01%	BRPP	3,01%	0,81%	2,44%	4,94%	4,94%	11,08%	29,74%	53,21%		
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	163.956,05	0,08%	VILA RICA	1,88%	0,81%	2,44%	4,94%	4,94%	11,08%	29,74%	53,21%		
Benchmark:	CDI				0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%		
<b>Renda Variável</b>	<b>38.080.003,55</b>	<b>18,80%</b>											
Benchmark:	IBOVESPA				-5,20%	-14,76%	-4,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	37,08%		
<b>Renda Variável</b>	<b>38.080.003,55</b>	<b>18,80%</b>											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	5.413.324,81	2,67%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	32.666.678,74	16,13%	QUELUZ	100%	-3,82%	-11,23%	-1,08%	-1,08%	13,00%	24,18%	27,54%		
Benchmark:	IBOVESPA				-5,20%	-14,76%	-4,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	37,08%		
<b>Imobiliário</b>	<b>4.459.738,68</b>	<b>2,20%</b>											
Benchmark:	INPC + 6.5% a.a.				1,96%	3,70%	5,80%	5,80%	10,17%	20,31%	40,29%		
<b>FII</b>	<b>4.459.738,68</b>	<b>2,20%</b>											
VECTOR LAJES FII	4.459.738,68	2,20%	QUELUZ	6,81%	0,14%	-0,41%	1,78%	1,78%	5,14%	12,34%	-		
Benchmark:	IFIX				-4,01%	-9,85%	-4,55%	-4,55%	2,47%	29,74%	45,56%		
<b>Total</b>	<b>202.553.648,01</b>	<b>100%</b>											
Benchmark:	INPC + 5.5% a.a.				1,88%	3,46%	5,31%	5,31%	9,15%	18,07%	36,39%		

\* 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.

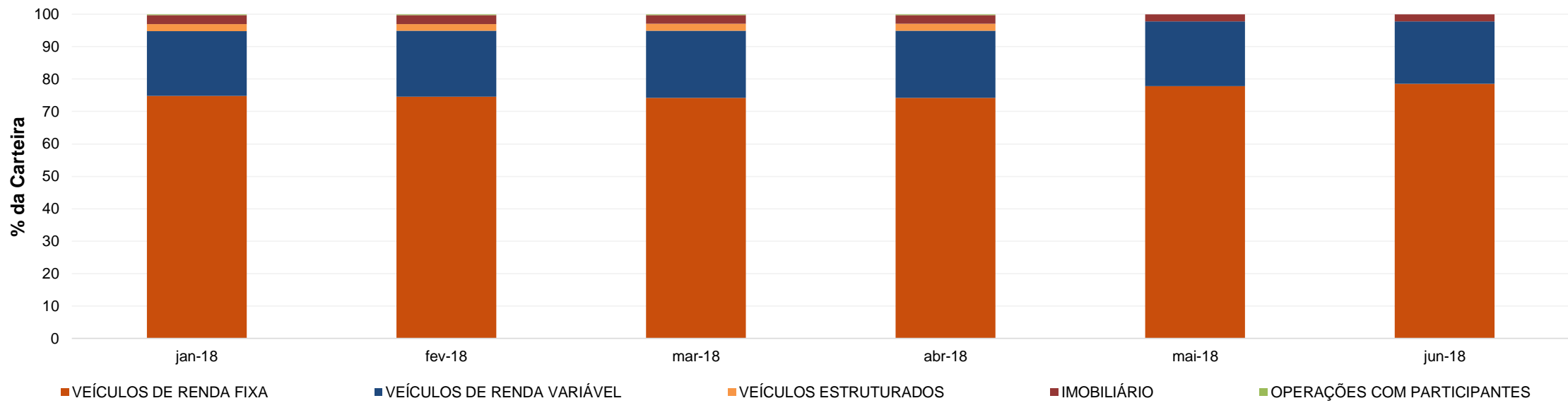
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

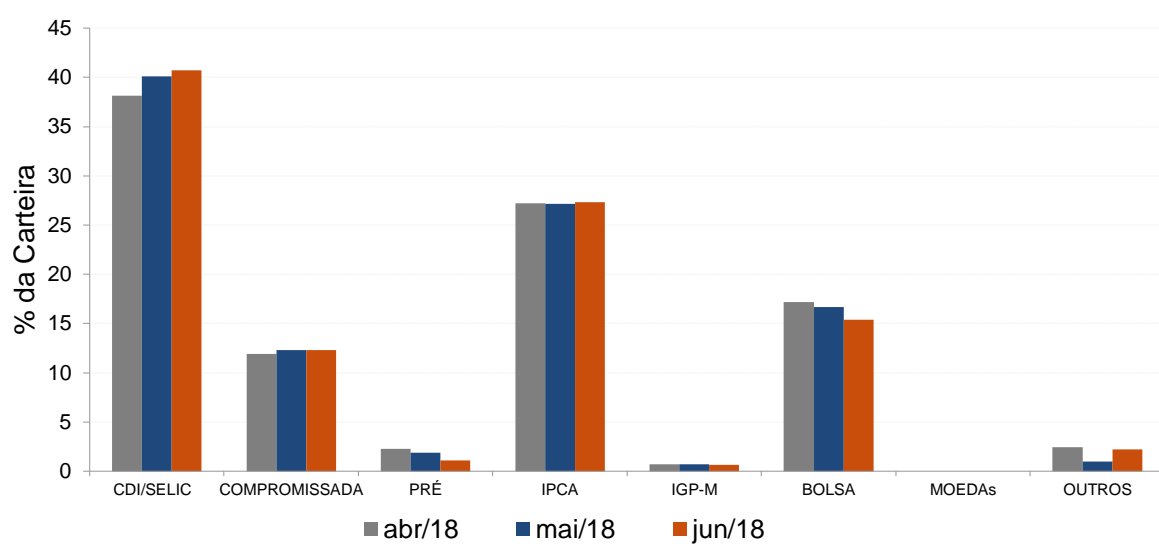
## Distribuição da Carteira

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.

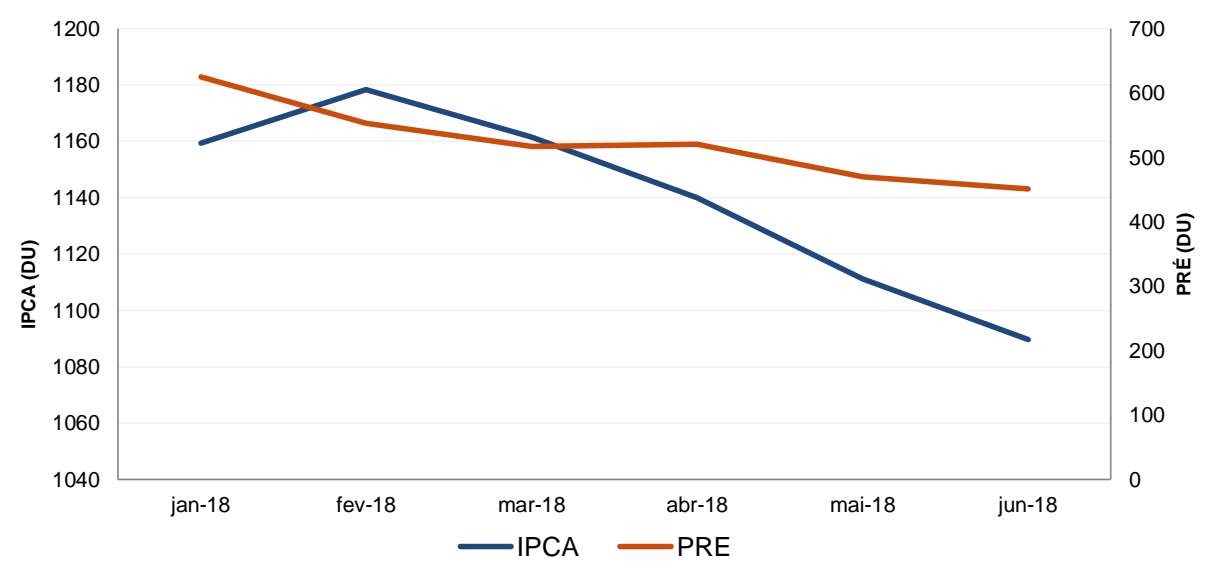
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	3.288,31	10,76	3.357,28	10,07
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.134,42	10,26	3.339,55	10,02
EQTL3	Energia Elétrica	3.060,44	10,02	3.276,58	9,83
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2.769,98	9,07	3.058,42	9,17
LREN3	Comércio	2.243,87	7,34	2.266,79	6,80
CVCB3	Viagens e Lazer	1.857,72	6,08	2.096,10	6,29
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.850,77	6,06	1.970,23	5,91
MULT3	Exploração de Imóveis	1.584,60	5,19	1.631,03	4,89
SUZB3	Madeira e Papel	1.578,45	5,17	2.159,31	6,48
RENT3	Diversos	1.556,69	5,09	1.622,29	4,87

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

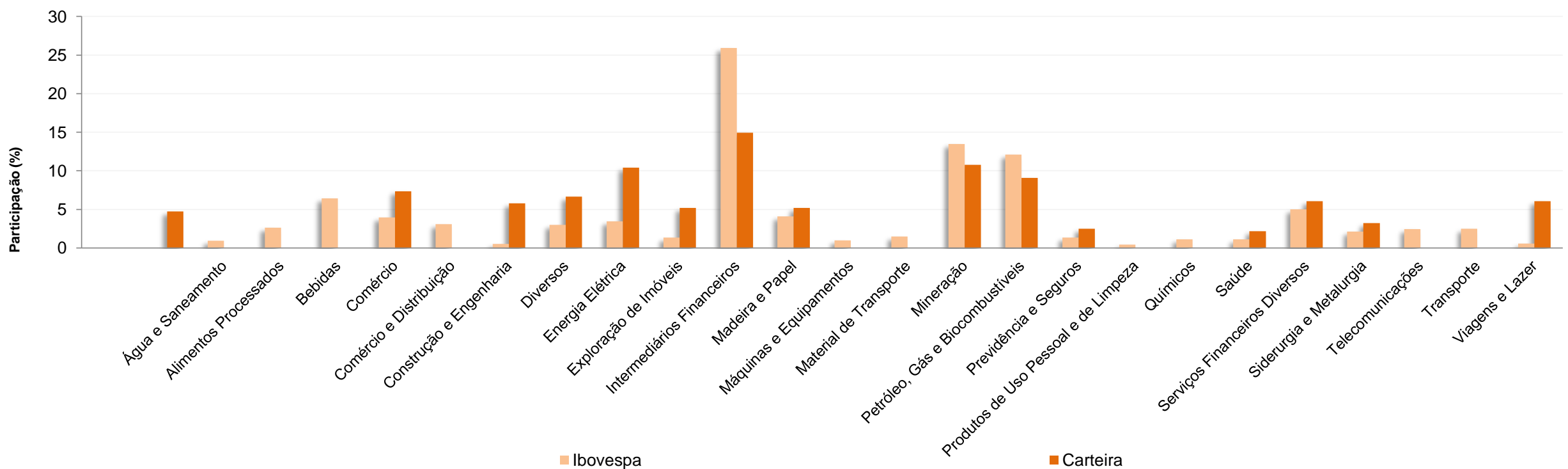
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	327,00	1,07	2,44	373
VALE3	3.288,31	10,76	0,00	1
ITUB4	3.134,42	10,26	0,00	1
EQTL3	3.060,44	10,02	0,03	1
PETR4	2.769,98	9,07	0,00	1
LREN3	2.243,87	7,34	0,01	1
CVCB3	1.857,72	6,08	0,03	1
B3SA3	1.850,77	6,06	0,00	1
MULT3	1.584,60	5,19	0,03	1
SUZB3	1.578,45	5,17	0,01	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

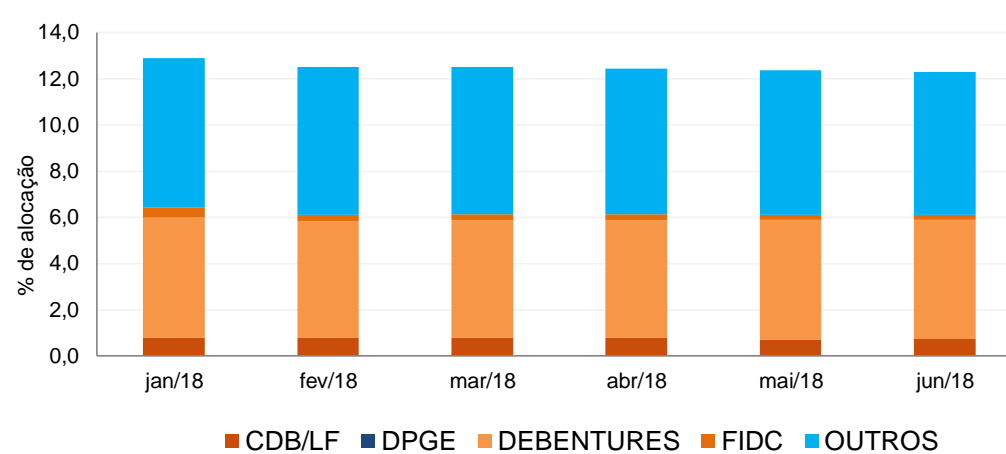
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	10.971,35	5,53			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	7.111,34	3,59	BBB- (bra)	B2.br	brBBB
VALE SA	3.288,31	1,66	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.134,42	1,58	AAA (bra)	A1.br	brAA-
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.060,44	1,54			brAA-
ALGAR TELECOM S.A	3.026,41	1,53			brAA-
BCO BRADESCO SA	2.824,60	1,42	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.769,98	1,40	AA (bra)	Aaa.br	brA+
LOJAS RENNEN SA	2.243,87	1,13			brAAA
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIA	1.857,72	0,94			

\* 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
CRI RB Capital 1 107	10.971,35	RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	A (bra)	AA (bra)	Fitch	20-jun-27	IPCA	6,85%	FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIETARIA



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/06/2018

**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.

Nenhuma operação feita no último mês.

