

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/01/2019

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 | 162.630.166,79 | 73,21% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 0,81% | 1,51% | 3,54% | 0,81% | 8,91% | 16,65% | 29,41% | | |
| Renda Fixa | 162.630.166,79 | 73,21% | | 0,42% | | | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF | 57.892.502,77 | 20,53% | | 126,93% | 1,08% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP | 20.403.391,65 | 9,18% | BB | 3,83% | 0,00% | 0,52% | 1,48% | 3,03% | 0,52% | 6,13% | 15,93% | 31,86% | |
| BRADESCO FI MULT FIOPREV | 54.239.035,21 | 24,42% | BRADESCO | 100% | 0,09% | 0,60% | 1,63% | 3,22% | 0,60% | 6,29% | 16,55% | 33,51% | |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 29.852.403,29 | 13,44% | BRADESCO | 0,42% | 0,00% | 0,53% | 1,49% | 3,06% | 0,53% | 6,18% | 16,11% | 32,04% | |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM | 199.374,74 | 0,09% | BRASIL PLURAL | 3,33% | | 0,85% | 2,40% | 4,94% | 0,85% | 10,07% | 24,59% | 47,07% | |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM | 18.903,63 | 0,01% | BRPP | 3,01% | | 0,85% | 2,40% | 4,94% | 0,85% | 10,07% | 24,59% | 47,07% | |
| FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN | 24.555,49 | 0,01% | VILA RICA | 1,88% | | 0,85% | 2,40% | 4,94% | 0,85% | 10,07% | 24,59% | 47,07% | |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,81% | 1,51% | 3,54% | 0,81% | 8,91% | 16,65% | 29,41% | |
| Renda Variável | 48.522.340,11 | 21,84% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | 10,82% | 11,40% | 22,94% | 10,82% | 14,70% | 50,60% | 141,04% | |
| Renda Variável | 48.522.340,11 | 21,84% | | 7,21% | | | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV | 6.706.170,42 | 3,02% | | 100% | 13,59% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| FIOPREV FIA | 41.816.169,69 | 18,82% | QUELUZ | 100% | 6,62% | 9,58% | 12,63% | 21,33% | 9,58% | 17,84% | 45,65% | 78,81% | |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | 10,82% | 11,40% | 22,94% | 10,82% | 14,70% | 50,60% | 141,04% | |
| Imobiliário ** | 22.570.348,26 | 10,16% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,81% | 1,51% | 3,54% | 0,81% | 8,91% | 16,65% | 29,41% | |
| CARTEIRA PRÓPRIA IM | 12.283.580,32 | 5,53% | | | | | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR | 12.283.580,32 | 5,53% | | 100% | 1,19% | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,54% | 1,54% | 3,15% | 0,54% | 6,38% | 16,38% | 32,72% | |
| Imóveis | 5.505.269,06 | 2,48% | | | | | | | | | | | |
| FII | 4.781.498,88 | 2,15% | | | | | | | | | | | |
| VECTOR LAJES FII | 4.781.498,88 | 2,15% | QUELUZ | 6,81% | | 1,85% | 2,80% | 5,67% | 1,85% | 8,29% | 17,44% | 24,20% | |
| Benchmark: | IFIX | | | | | 2,47% | 7,46% | 11,85% | 2,47% | 5,45% | 24,60% | 82,28% | |
| Operações com Participantes ** | 606.291,56 | 0,27% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,81% | 1,51% | 3,54% | 0,81% | 8,91% | 16,65% | 29,41% | |
| Total | 222.148.988,68 | 100% | | | 1,88% | | | | | | | | |
| Benchmark: | INPC + 4.2% a.a. | | | | | 0,72% | 1,27% | 3,05% | 0,72% | 7,88% | 14,46% | 25,78% | |

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/12/2018

* 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.

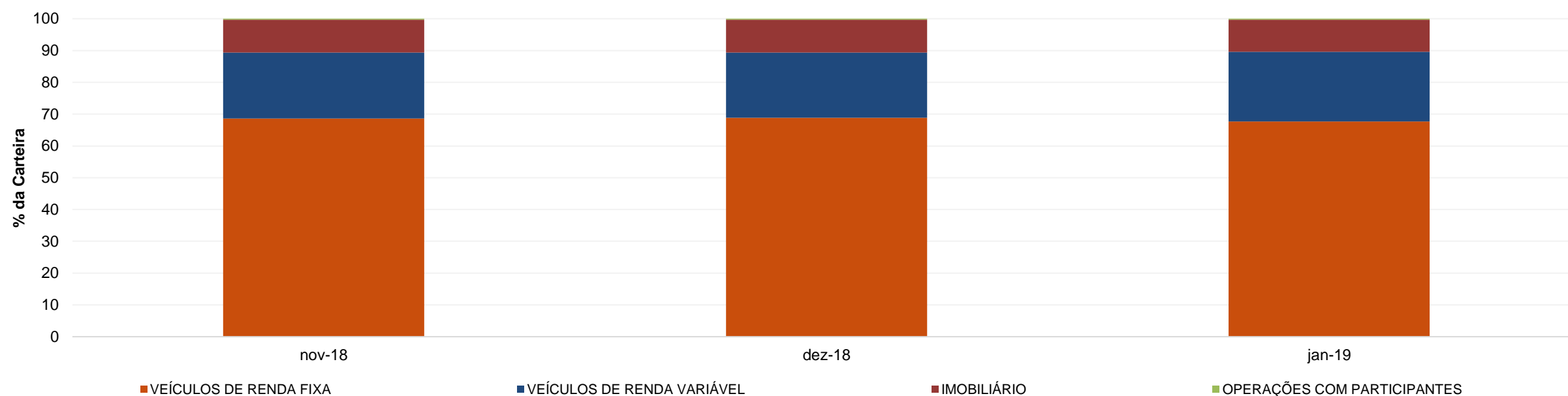
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

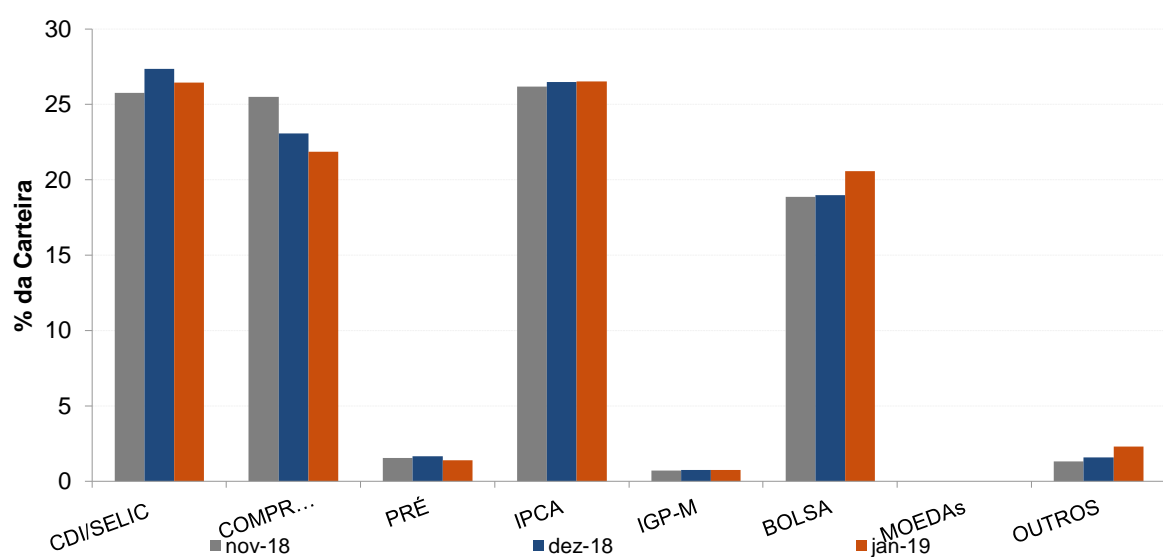
Distribuição da Carteira

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.

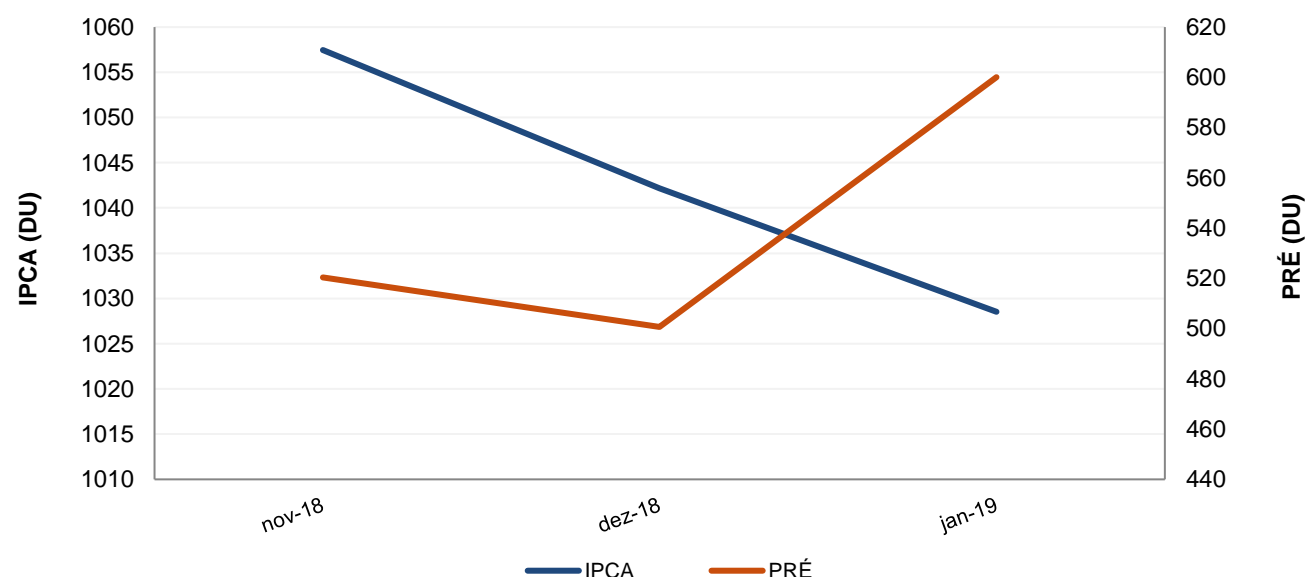
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | Setor | Atual* | % | Anterior* | % |
|--------|---------------------------------|----------|-------|-----------|-------|
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 7.194,09 | 16,14 | 6.383,04 | 15,93 |
| VALE3 | Mineração | 4.341,16 | 9,74 | 4.712,91 | 11,76 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 4.086,98 | 9,17 | 490,86 | 1,22 |
| BBAS3 | Intermediários Financeiros | 3.241,25 | 7,27 | 1.957,23 | 4,88 |
| PCAR4 | Comércio e Distribuição | 2.889,22 | 6,48 | 2.405,11 | 6,00 |
| B3SA3 | Serviços Financeiros Diversos | 2.882,71 | 6,47 | 1.549,67 | 3,87 |
| BRML3 | Exploração de Imóveis | 2.090,84 | 4,69 | 1.099,19 | 2,74 |
| RENT3 | Diversos | 1.851,48 | 4,16 | 2.448,43 | 6,11 |
| LAME3 | Comércio | 1.779,41 | 3,99 | 2.531,05 | 6,32 |
| ENGI11 | Energia Elétrica | 1.768,08 | 3,97 | 0,00 | |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

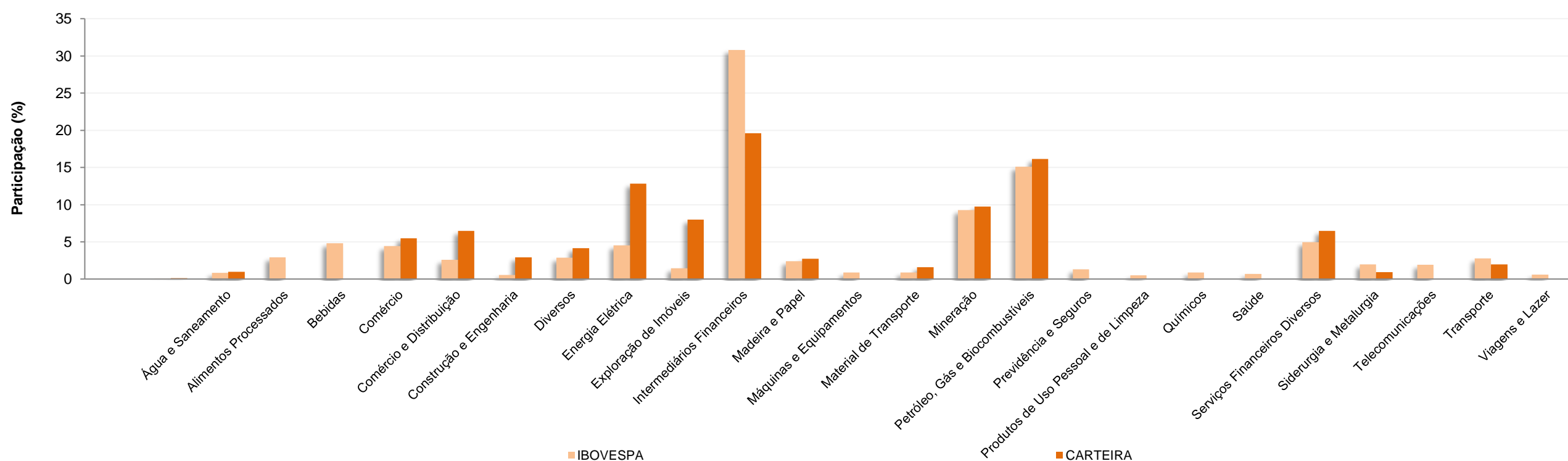
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|-------|--------------|--------------------|
| JFEN3 | 458,93 | 1,03 | 2,33 | 174 |
| PETR4 | 7.194,09 | 16,14 | 0,01 | 1 |
| VALE3 | 4.341,16 | 9,74 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 4.086,98 | 9,17 | 0,00 | 1 |
| BBAS3 | 3.241,25 | 7,27 | 0,00 | 1 |
| PCAR4 | 2.889,22 | 6,48 | 0,02 | 1 |
| B3SA3 | 2.882,71 | 6,47 | 0,00 | 1 |
| BRML3 | 2.090,84 | 4,69 | 0,02 | 1 |
| RENT3 | 1.851,48 | 4,16 | 0,01 | 1 |
| LAME3 | 1.779,41 | 3,99 | 0,06 | 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.



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/01/2019

Análises de Contrapartes

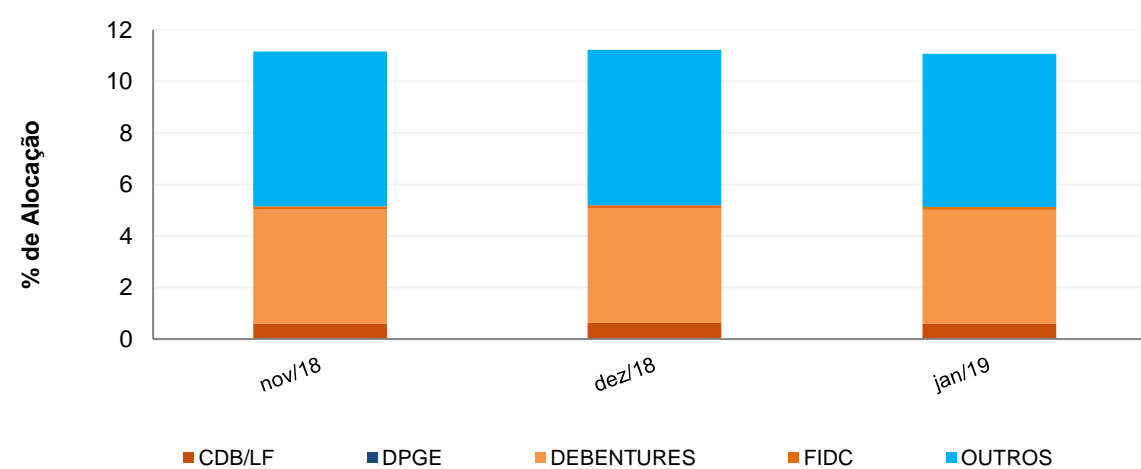
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 | 11.218,81 | 5,18 | | | |
| CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA | 7.983,37 | 3,69 | A- (bra) | Baa2.br | brA+ |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 7.194,09 | 3,32 | AA (bra) | Aaa.br | brAAA |
| BCO BRADESCO SA | 5.855,74 | 2,71 | AAA (bra) | Aa1.br | brAAA |
| VALE SA | 4.341,16 | 2,01 | AAA (bra) | Aaa.br | brAAA |
| BCO BRASIL SA | 3.241,25 | 1,50 | AA (bra) | Aa1.br | |
| COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAC | 2.889,22 | 1,33 | AA (bra) | | brAAA |
| B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO | 2.882,71 | 1,33 | | Aaa.br | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 2.090,84 | 0,97 | AAA (bra) | Aa1.br | |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 1.851,48 | 0,86 | AAA (bra) | Aa1.br | 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. | | | | | | | | | |

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 com alocação direta.

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Data Compra | x de Compr | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|-------------|------------|----------------|------------------------------------|
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 334.748 | 0,15% | Selic | 11-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 251.058 | 0,12% | Selic | 17-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 83.686 | 0,04% | Selic | 24-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 543.924 | 0,25% | Selic | 09-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 251.042 | 0,12% | Selic | 17-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 209.202 | 0,10% | Selic | 03-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 167.361 | 0,08% | Selic | 17-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 20.920 | 0,01% | Selic | 16-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1.674 | 0,00% | Selic | 10-jan-19 | 0,00% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 209.190 | 0,10% | Selic | 17-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 209.190 | 0,10% | Selic | 17-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 66.941 | 0,03% | Selic | 14-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 54.389 | 0,03% | Selic | 18-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 25.940 | 0,01% | Selic | 15-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 80.310 | 0,04% | Selic | 31-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 292.756 | 0,14% | Selic | 30-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 154.742 | 0,07% | Selic | 23-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 1.715 | 0,00% | Selic | 14-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 154.722 | 0,07% | Selic | 29-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 14.636 | 0,01% | Selic | 14-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 418 | 0,00% | Selic | 14-jan-19 | 0,01% | 0,01% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 135.870 | 0,06% | Selic | 30-jan-19 | 0,02% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 20.901 | 0,01% | Selic | 31-jan-19 | 0,02% | 0,00% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 161.723 | 0,07% | Selic | 25-jan-19 | 0,02% | 0,02% | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 256.749 | 0,12% | IPCA | 09-jan-19 | 4,14% | 4,05% | BRDESCO FI MULT FIOPREV |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 156.131 | 0,07% | IPCA | 08-jan-19 | 4,13% | 4,11% | BRDESCO FI MULT FIOPREV |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 38.165 | 0,02% | IPCA | 09-jan-19 | 4,14% | 4,05% | BRDESCO FI MULT FIOPREV |
| NTN-B 2050-08-15 | 15-ago-50 | 28.379 | 0,01% | IPCA | 31-jan-19 | 4,55% | 4,48% | BRDESCO FI MULT FIOPREV |

