

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 28/02/2019

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	150.999.951,71	68,17%											
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,95%	2,31%	4,04%	1,76%	9,34%	17,05%	28,91%		
Renda Fixa	150.999.951,71	68,17%		0,28%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	44.463.417,85	20,07%		100%	0,90%	-	-	-	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	20.500.277,05	9,26%	BB	3,75%	0,00%	0,47%	1,48%	2,96%	1,00%	6,16%	15,49%	31,20%	
BRADESCO FI MULT FIOPREV	54.485.069,65	24,60%	BRADESCO	100%	0,04%	0,45%	1,60%	3,30%	1,05%	6,21%	15,91%	32,85%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	31.267.700,24	14,12%	BRADESCO	0,45%	0,00%	0,48%	1,49%	2,99%	1,01%	6,22%	15,68%	31,39%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	199.088,30	0,09%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,77%	2,40%	4,82%	1,62%	10,13%	24,16%	46,35%	
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	19.086,36	0,01%	BRPP	3,01%		0,77%	2,40%	4,82%	1,62%	10,13%	24,16%	46,35%	
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	65.312,24	0,03%	VILA RICA	1,88%		0,77%	2,40%	4,82%	1,62%	10,13%	24,16%	46,35%	
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,95%	2,31%	4,04%	1,76%	9,34%	17,05%	28,91%		
Renda Variável	48.394.756,84	21,85%											
Benchmark:	IBOVESPA				-1,86%	6,79%	24,66%	8,76%	11,99%	43,39%	123,36%		
Renda Variável	48.394.756,84	21,85%		5,89%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.997.158,34	3,16%		100%	11,42%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	41.397.598,50	18,69%	QUELUZ	100%	5,41%	-1,00%	9,20%	25,81%	8,48%	15,46%	39,52%	75,53%	
Benchmark:	IBOVESPA				-1,86%	6,79%	24,66%	8,76%	11,99%	43,39%	123,36%		
Imobiliário **	22.449.715,64	10,14%											
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,95%	2,31%	4,04%	1,76%	9,34%	17,05%	28,91%		
CARTEIRA PRÓPRIA IM	12.225.399,44	5,52%											
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR	12.225.399,44	5,52%		100%	1,02%	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				0,49%	1,54%	3,07%	1,04%	6,41%	15,95%	32,05%		
Imóveis	5.498.814,30	2,48%											
FII	4.725.501,90	2,13%											
VECTOR LAJES FII	4.725.501,90	2,13%	QUELUZ	6,81%		-1,17%	1,29%	4,10%	0,65%	6,59%	14,87%	21,94%	
Benchmark:	IFIX				1,03%	5,83%	13,80%	3,53%	5,33%	20,05%	78,88%		
Operações com Participantes **	606.156,47	0,27%											
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,95%	2,31%	4,04%	1,76%	9,34%	17,05%	28,91%		
Total	221.503.826,75	100%			1,53%								
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.				0,87%	2,07%	3,56%	1,60%	8,31%	14,84%	25,29%		

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/01/2019

* 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.

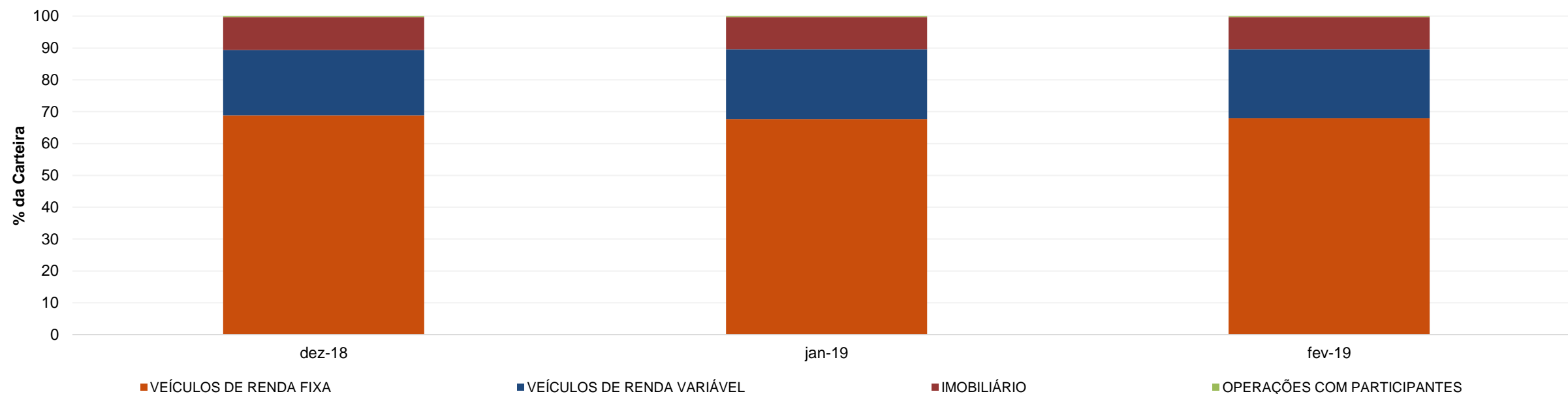
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

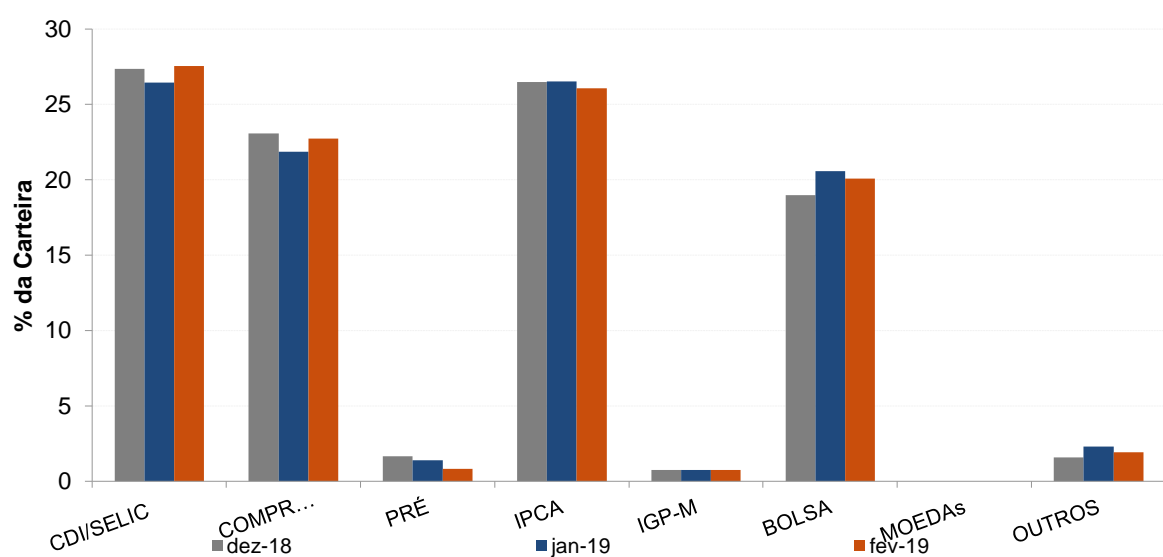
Distribuição da Carteira

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.

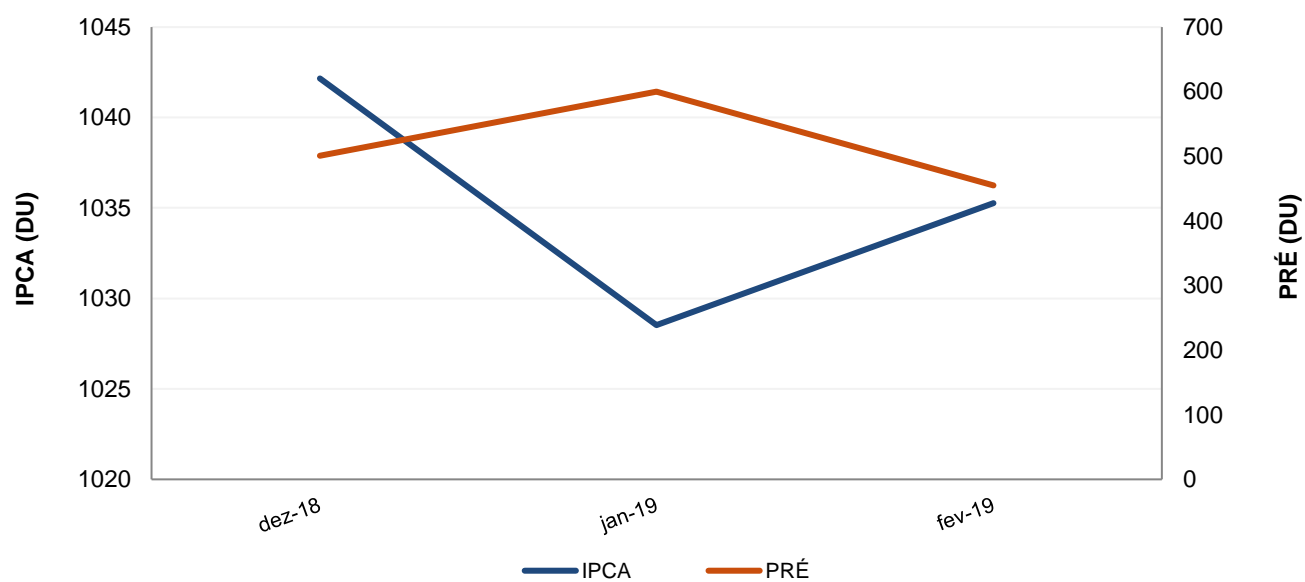
Evolução do Patrimônio Líquido



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	7.610,33	17,57	7.194,09	16,14
VALE3	Mineração	4.908,29	11,33	4.341,16	9,74
BBDC4	Intermediários Financeiros	3.907,28	9,02	4.086,98	9,17
BBAS3	Intermediários Financeiros	3.162,50	7,30	3.241,25	7,27
PCAR4	Comércio e Distribuição	2.765,37	6,38	2.889,22	6,48
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.662,61	6,15	2.882,71	6,47
ENGI11	Energia Elétrica	2.550,99	5,89	1.768,08	3,97
RENT3	Diversos	2.080,39	4,80	1.851,48	4,16
BRML3	Exploração de Imóveis	1.924,14	4,44	2.090,84	4,69
CESP6	Energia Elétrica	1.809,91	4,18	1.711,53	3,84

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

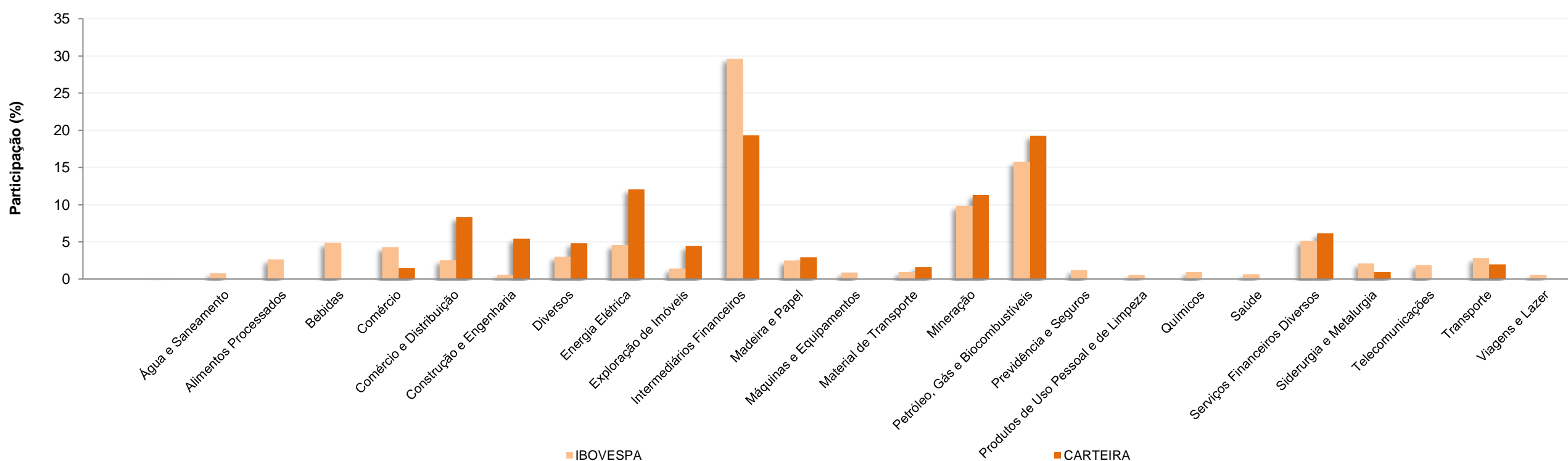
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	436,70	1,01	2,33	393
PETR4	7.610,33	17,57	0,01	1
VALE3	4.908,29	11,33	0,00	1
BBDC4	3.907,28	9,02	0,00	1
BBAS3	3.162,50	7,30	0,00	1
PCAR4	2.765,37	6,38	0,02	1
B3SA3	2.662,61	6,15	0,00	1
PCAR4	2.765,37	6,38	0,02	1
B3SA3	2.662,61	6,15	0,00	1
ENGI11	2.550,99	5,89	0,03	1
RENT3	2.080,39	4,80	0,01	1
BRML3	1.924,14	4,44	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

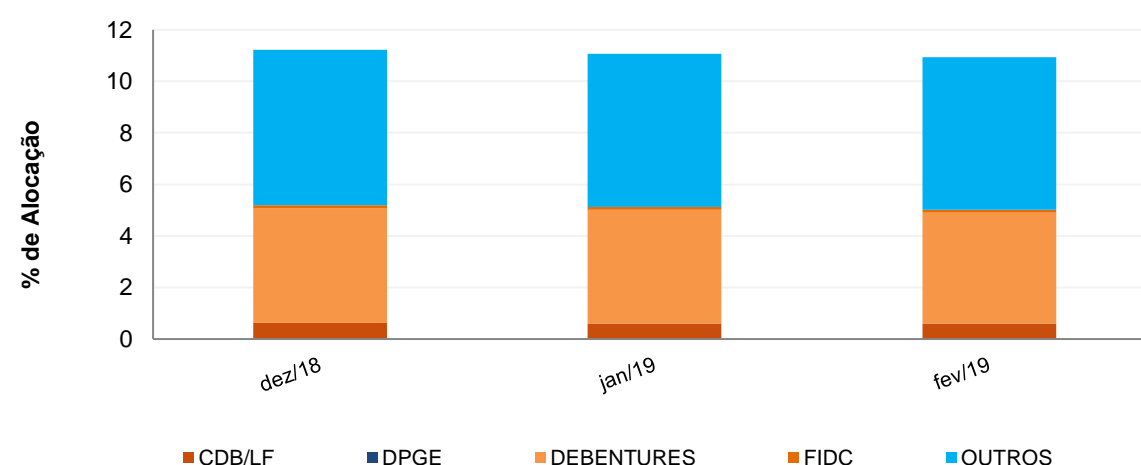
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.159,00	5,17			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	7.651,46	3,54	A- (bra)	Baa2.br	brA+
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	7.610,33	3,53	AA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO BRADESCO SA	5.665,12	2,62	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
VALE SA	4.908,29	2,27	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO BRASIL SA	3.162,50	1,47	AA (bra)	Aa1.br	
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAC	2.765,37	1,28	AA (bra)		brAAA
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.662,61	1,23		Aaa.br	
ENERGISA SA	2.550,99	1,18	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	2.080,39	0,96	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.									

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 28/02/2019

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 2019-03-01	01-mar-19	150.038	0,07%	Selic	27-fev-19	0,03%	0,00%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-09-01	01-set-21	453.905	0,21%	Selic	21-fev-19	0,01%	0,01%	BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA

