

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/05/2019

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 | 154.196.906,68 | 68,44% | | | | 0,18% | 2,62% | 5,12% | 4,21% | 9,78% | 20,06% | 36,87% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,59% | 2,80% | 5,18% | 4,61% | 10,21% | 17,91% | 28,20% |
| Renda Fixa | 154.196.906,68 | 68,44% | | | | 0,37% | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF | 46.459.055,92 | 20,62% | | 100% | 1,14% | 0,94% | - | - | - | - | - | - |
| BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP | 20.803.891,88 | 9,23% | BB | 4,24% | 0,00% | 0,52% | 1,48% | 2,98% | 2,50% | 6,13% | 14,07% | 28,91% |
| BRADESCO FI MULT FIOPREV | 55.318.232,39 | 24,55% | BRADESCO | 100% | 0,06% | 0,61% | 1,53% | 3,15% | 2,60% | 6,31% | 14,36% | 30,36% |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 31.271.028,92 | 13,88% | BRADESCO | 0,35% | 0,00% | 0,53% | 1,49% | 3,01% | 2,52% | 6,19% | 14,24% | 29,14% |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM | 195.996,05 | 0,09% | BRASIL PLURAL | 3,33% | 0,85% | 2,40% | 4,86% | 4,06% | 10,08% | 22,63% | 43,75% | |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM | 19.301,77 | 0,01% | BRPP | 3,01% | 0,85% | 2,40% | 4,86% | 4,06% | 10,08% | 22,63% | 43,75% | |
| FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN | 129.399,75 | 0,06% | VILA RICA | 1,88% | 0,85% | 2,40% | 4,86% | 4,06% | 10,08% | 22,63% | 43,75% | |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,59% | 2,80% | 5,18% | 4,61% | 10,21% | 17,91% | 28,20% |
| Renda Variável | 48.886.240,69 | 21,70% | | | | 0,24% | 1,26% | 9,22% | 9,91% | 23,40% | 45,24% | 63,22% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | 0,70% | 1,51% | 8,41% | 10,40% | 26,42% | 54,73% | 100,18% |
| Renda Variável | 48.886.240,69 | 21,70% | | | | 6,68% | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV | 6.778.232,25 | 3,01% | | 100% | 8,36% | - | - | - | - | - | - | - |
| FIOPREV FIA | 42.108.008,44 | 18,69% | QUELUZ | 100% | 6,73% | 2,62% | 1,72% | 11,07% | 10,35% | 23,97% | 47,42% | 66,47% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | 0,70% | 1,51% | 8,41% | 10,40% | 26,42% | 54,73% | 100,18% |
| Imobiliário | 22.707.729,26 | 10,08% | | | | 1,01% | 3,81% | 7,24% | 6,33% | 14,32% | 5,50% | 13,18% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,59% | 2,80% | 5,18% | 4,61% | 10,21% | 17,91% | 28,20% |
| CARTEIRA PRÓPRIA IM | 12.349.536,28 | 5,48% | | | | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/ | 12.349.536,28 | 5,48% | | 100% | 1,43% | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,54% | 1,54% | 3,10% | 2,59% | 6,37% | 14,54% | 29,73% |
| Imóveis | 5.468.227,99 | 2,43% | | | | | | | | | | |
| FII | 4.889.964,99 | 2,17% | | | | | | | | | | |
| VECTOR LAJES FII | 4.889.964,99 | 2,17% | QUELUZ | 6,81% | | 1,81% | 3,48% | 4,82% | 4,16% | 9,80% | 15,84% | 23,18% |
| Benchmark: | IFIX | | | | | 1,76% | 4,85% | 10,96% | 8,55% | 15,29% | 24,16% | 58,36% |
| Operações com Participantes | 551.077,92 | 0,24% | | | | 0,00% | 174,09% | 94,19% | 61,76% | 155,12% | 178,00% | 163,10% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | | 0,59% | 2,80% | 5,18% | 4,61% | 10,21% | 17,91% | 28,20% |
| Total | 225.301.283,08 | 100% | | | | 1,78% | 0,28% | 2,64% | 6,38% | 5,73% | 13,18% | 24,80% |
| Benchmark: | INPC + 4.2% a.a. | | | | | 0,51% | 2,56% | 4,68% | 4,20% | 9,16% | 15,70% | 24,59% |

* 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.

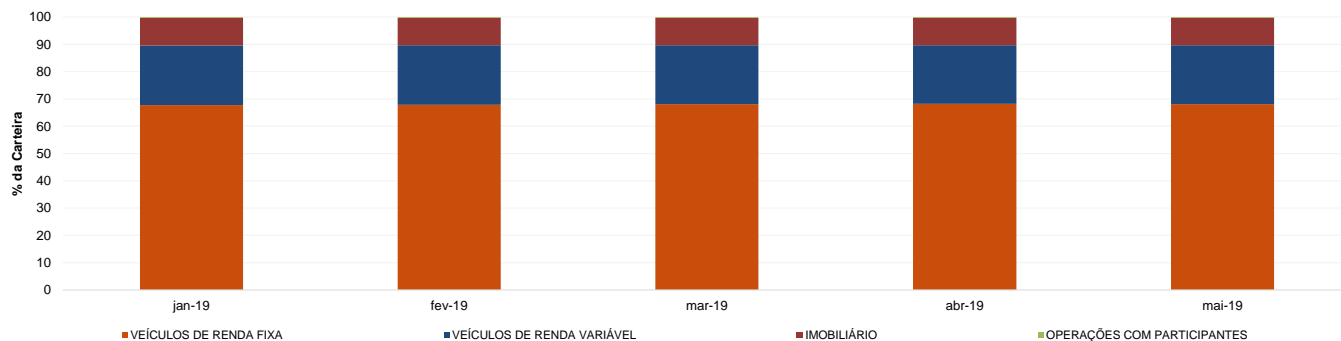
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

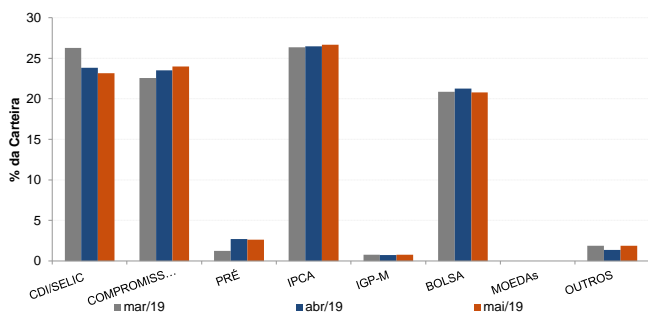
Distribuição da Carteira

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.

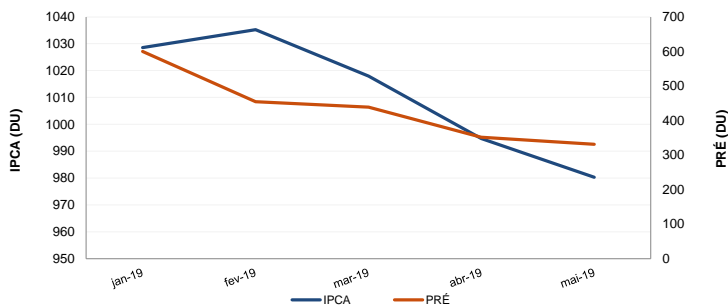
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 7.936,83 | 17,40 | 8.009,35 | 17,35 |
| BBAS3 | Intermediários Financeiros | 4.116,89 | 9,02 | 3.944,59 | 8,54 |
| VALE3 | Mineração | 3.807,79 | 8,35 | 5.596,67 | 12,12 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 3.377,51 | 7,40 | 2.221,22 | 4,81 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 3.204,78 | 7,02 | 3.054,12 | 6,62 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 3.143,52 | 6,89 | 3.022,88 | 6,55 |
| ALSC3 | Exploração de Imóveis | 2.200,00 | 4,82 | 0,00 | |
| PCAR4 | Comércio e Distribuição | 2.162,81 | 4,74 | 2.866,05 | 6,21 |
| RAIL3 | Transporte | 1.961,17 | 4,30 | 1.619,95 | 3,51 |
| BRML3 | Exploração de Imóveis | 1.940,72 | 4,25 | 2.435,40 | 5,28 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

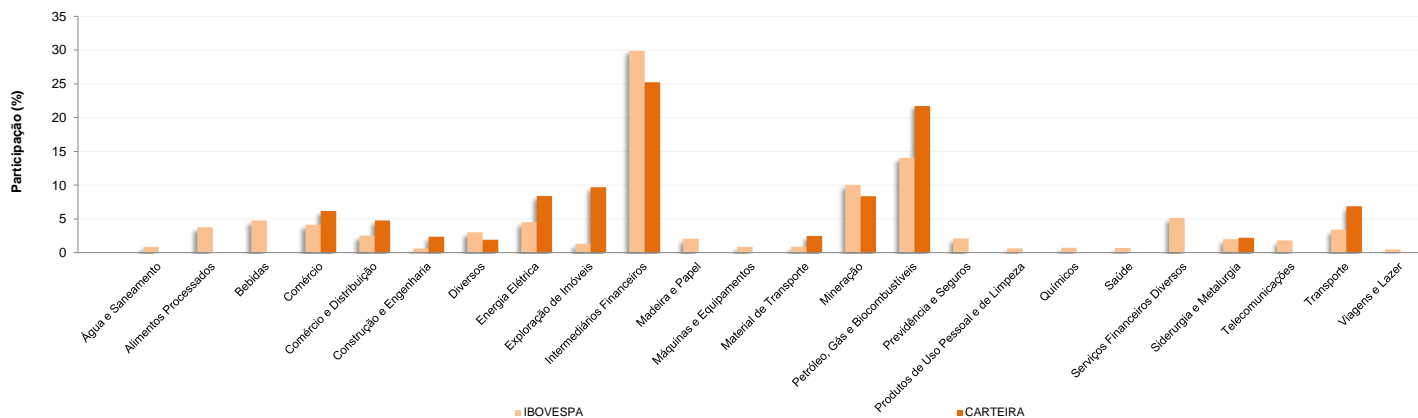
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|-------|--------------|--------------------|
| JFEN3 | 372,34 | 0,82 | 2,33 | 695 |
| ALSC3 | 2.200,00 | 4,82 | 0,11 | 2 |
| PETR4 | 7.936,83 | 17,40 | 0,01 | 1 |
| BBAS3 | 4.116,89 | 9,02 | 0,01 | 1 |
| VALE3 | 3.807,79 | 8,35 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 3.377,51 | 7,40 | 0,01 | 1 |
| EQTL3 | 3.204,78 | 7,02 | 0,02 | 1 |
| BBDC4 | 3.143,52 | 6,89 | 0,00 | 1 |
| PCAR4 | 2.162,81 | 4,74 | 0,02 | 1 |
| RAIL3 | 1.961,17 | 4,30 | 0,01 | 1 |

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segregava as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



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.

Análises de Contrapartes

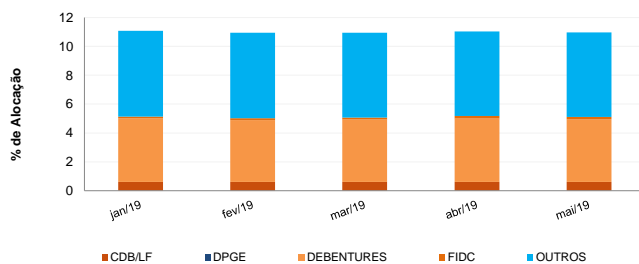
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 | 11.200,45 | 5,10 | | | |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 8.707,51 | 3,96 | AA (bra) | Aaa.br | brAAA |
| CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA | 7.996,45 | 3,64 | A- (bra) | Baa2.br | brA+ |
| BCO BRADESCO SA | 4.489,74 | 2,04 | AAA (bra) | Aa1.br | brAAA |
| BCO BRASIL SA | 4.116,89 | 1,87 | AA (bra) | Aa1.br | |
| VALE SA | 3.807,79 | 1,73 | AAA (bra) | Aaa.br | brAAA |
| ITAU INVESTS ITAU SA | 3.380,04 | 1,54 | | A1.br | |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 3.204,78 | 1,46 | | | brAAA |
| ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA | 2.200,00 | 1,00 | AA (bra) | | |
| COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO | 2.162,81 | 0,98 | AA (bra) | | 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 |
|---------------------------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|
| Nenhuma mudança de rating encontrada. | | | | | | | | | |

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base:

31/05/2019

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 | Tx Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|-------------|-----------|----------------|-------------------------------------|
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 44.377 | 0,02% | Selic | 31-mai-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 184.893 | 0,08% | Selic | 09-mai-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 36.646 | 0,02% | Selic | 28-mai-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 333 | 0,00% | Selic | 28-mai-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 166.378 | 0,08% | Selic | 28-mai-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 153.643 | 0,07% | Selic | 28-mai-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 12.717 | 0,01% | Selic | 28-mai-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 73.920 | 0,03% | Selic | 02-mai-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |