

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 28/06/2019

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           |
| <b>Renda Fixa</b>                           | <b>155.591.843,98</b> | <b>67,75%</b> |               |                  | <b>1,11%</b>   | <b>3,14%</b> | <b>5,37%</b>  | <b>5,37%</b>  | <b>10,57%</b> | <b>20,66%</b> | <b>36,47%</b> |
| Benchmark:                                  | INPC + 5.2% a.a.      |               |               |                  | 0,39%          | 2,03%        | 5,02%         | 5,02%         | 8,62%         | 18,23%        | 27,53%        |
| <b>Renda Fixa</b>                           | <b>155.591.843,98</b> | <b>67,75%</b> |               | <b>0,72%</b>     |                |              |               |               |               |               |               |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF        | 47.650.702,34         | 20,75%        |               | 100%             | 2,26%          | 0,47%        | -             | -             | -             | -             | -             |
| BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP        | 20.897.744,46         | 9,10%         | BB            | 4,26%            | 0,00%          | 0,45%        | 1,48%         | 2,96%         | 2,96%         | 6,08%         | 13,65%        |
| BRADESCO FI MULT FIOPREV                    | 55.603.619,49         | 24,21%        | BRADESCO      | 100%             | 0,07%          | 0,52%        | 1,63%         | 3,13%         | 3,13%         | 6,42%         | 14,03%        |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA         | 31.102.782,65         | 13,54%        | BRADESCO      | 0,35%            | 0,00%          | 0,46%        | 1,49%         | 2,99%         | 2,99%         | 6,14%         | 13,79%        |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM              | 193.071,44            | 0,08%         | BRASIL PLURAL | 3,33%            |                | 0,73%        | 2,40%         | 4,82%         | 4,82%         | 9,99%         | 22,18%        |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM           | 13.382,30             | 0,01%         | BRPP          | 3,01%            |                | 0,73%        | 2,40%         | 4,82%         | 4,82%         | 9,99%         | 22,18%        |
| FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN         | 130.541,31            | 0,06%         | VILA RICA     | 1,88%            |                | 0,73%        | 2,40%         | 4,82%         | 4,82%         | 9,99%         | 22,18%        |
| Benchmark:                                  | INPC + 5.2% a.a.      |               |               |                  | 0,39%          | 2,03%        | 5,02%         | 5,02%         | 8,62%         | 18,23%        | 27,53%        |
| <b>Renda Variável</b>                       | <b>51.646.200,48</b>  | <b>22,49%</b> |               |                  | <b>5,65%</b>   | <b>7,17%</b> | <b>16,12%</b> | <b>16,12%</b> | <b>36,36%</b> | <b>54,32%</b> | <b>65,16%</b> |
| Benchmark:                                  | IBOVESPA              |               |               |                  | 4,06%          | 5,82%        | 14,88%        | 14,88%        | 38,76%        | 60,52%        | 95,95%        |
| <b>Renda Variável</b>                       | <b>51.646.200,48</b>  | <b>22,49%</b> |               | <b>7,93%</b>     |                |              |               |               |               |               |               |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV        | 7.176.346,19          | 3,12%         |               | 100%             | 7,38%          | -            | -             | -             | -             | -             | -             |
| FIOPREV FIA                                 | 44.469.854,29         | 19,36%        | QUELUZ        | 100%             | 8,40%          | 5,61%        | 8,45%         | 16,54%        | 16,54%        | 36,13%        | 53,83%        |
| Benchmark:                                  | IBOVESPA              |               |               |                  | 4,06%          | 5,82%        | 14,88%        | 14,88%        | 38,76%        | 60,52%        | 95,95%        |
| <b>Imobiliário</b>                          | <b>22.935.770,47</b>  | <b>9,99%</b>  |               |                  | <b>1,85%</b>   | <b>5,03%</b> | <b>8,30%</b>  | <b>8,30%</b>  | <b>16,07%</b> | <b>6,84%</b>  | <b>14,61%</b> |
| Benchmark:                                  | INPC + 5.2% a.a.      |               |               |                  | 0,39%          | 2,03%        | 5,02%         | 5,02%         | 8,62%         | 18,23%        | 27,53%        |
| <b>CARTEIRA PRÓPRIA IM</b>                  | <b>12.479.977,36</b>  | <b>5,43%</b>  |               |                  |                |              |               |               |               |               |               |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR | 12.479.977,36         | 5,43%         |               | 100%             | 2,69%          | -            | -             | -             | -             | -             | -             |
| Benchmark:                                  | CDI                   |               |               |                  | 0,47%          | 1,54%        | 3,07%         | 3,07%         | 6,32%         | 14,15%        | 28,84%        |
| <b>Imóveis</b>                              | <b>5.461.773,23</b>   | <b>2,38%</b>  |               |                  |                |              |               |               |               |               |               |
| <b>FII</b>                                  | <b>4.994.019,88</b>   | <b>2,17%</b>  |               |                  |                |              |               |               |               |               |               |
| VECTOR LAJES FII                            | 4.994.019,88          | 2,17%         | QUELUZ        | 6,81%            |                | 2,13%        | 4,91%         | 6,37%         | 6,37%         | 11,98%        | 17,74%        |
| Benchmark:                                  | IFIX                  |               |               |                  | 2,88%          | 5,77%        | 11,67%        | 11,67%        | 23,57%        | 26,62%        | 60,32%        |
| <b>Operações com Participantes</b>          | <b>528.172,60</b>     | <b>0,23%</b>  |               |                  |                |              |               |               |               |               |               |
| Benchmark:                                  | INPC + 5.2% a.a.      |               |               |                  | 0,39%          | 2,03%        | 5,02%         | 5,02%         | 8,62%         | 18,23%        | 27,53%        |
| <b>Total</b>                                | <b>229.658.441,56</b> | <b>100%</b>   |               |                  | <b>2,37%</b>   | <b>2,16%</b> | <b>4,19%</b>  | <b>8,02%</b>  | <b>8,02%</b>  | <b>16,27%</b> | <b>27,01%</b> |
| Benchmark:                                  | INPC + 4.2% a.a.      |               |               |                  | 0,32%          | 1,79%        | 4,53%         | 4,53%         | 7,60%         | 16,02%        | 23,96%        |

\* 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.

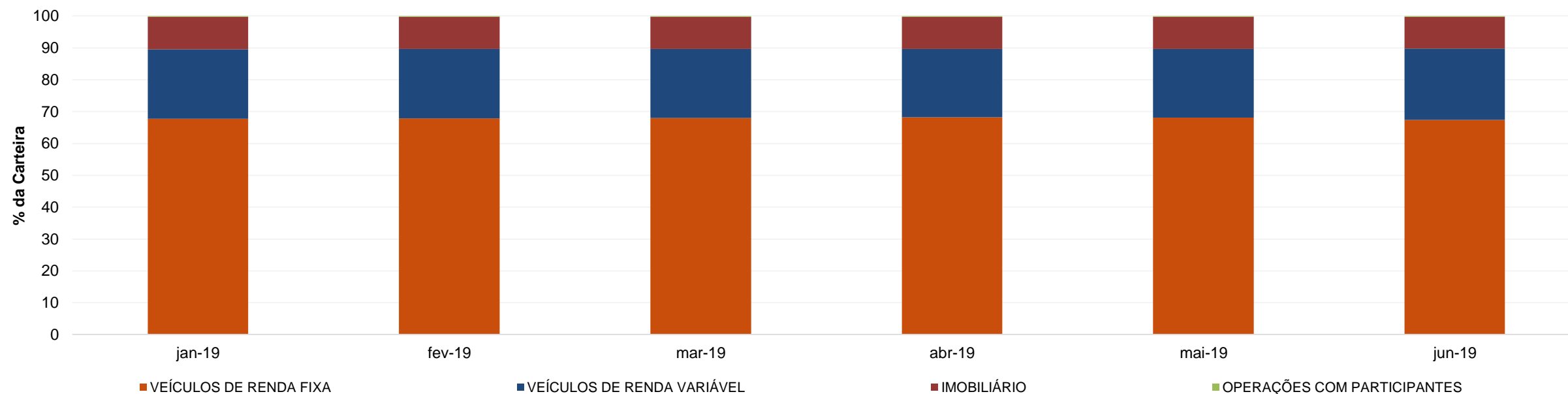
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

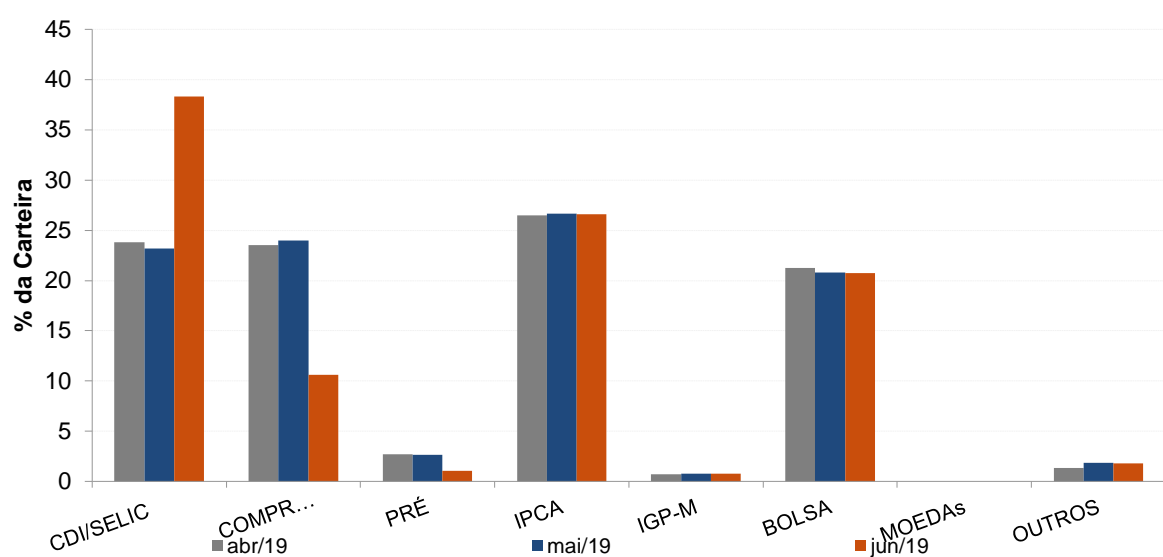
## Distribuição da Carteira

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.

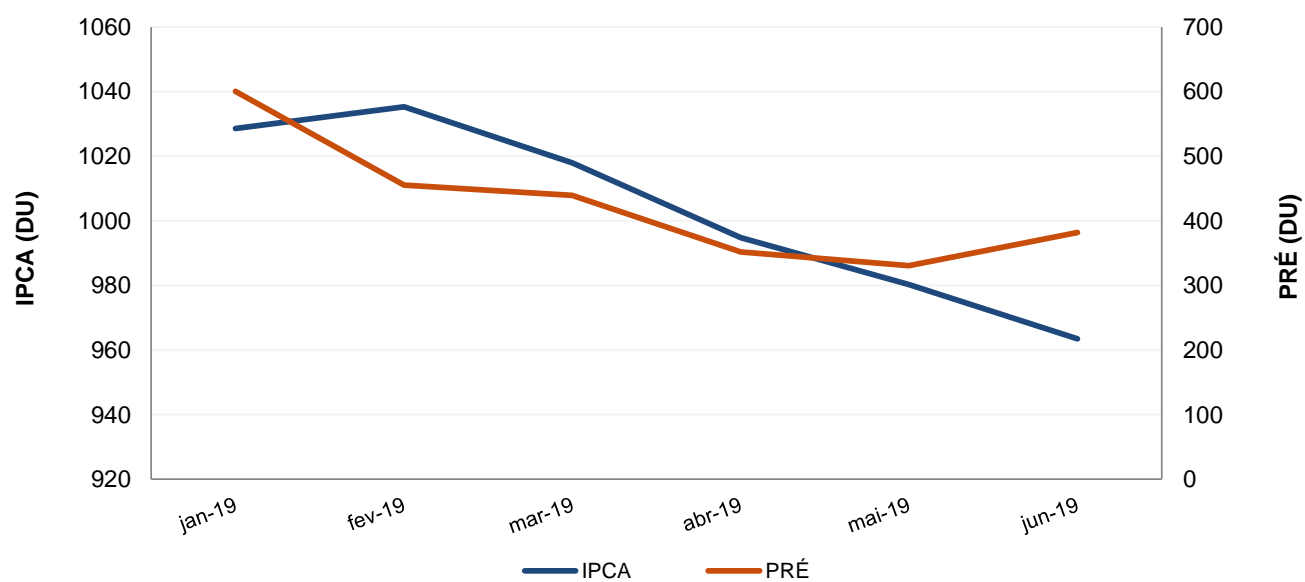
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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 | 8.514,61 | 18,32 | 7.936,83  | 17,40 |
| VALE3  | Mineração                       | 6.032,37 | 12,98 | 3.807,79  | 8,35  |
| ITSA4  | Intermediários Financeiros      | 3.513,81 | 7,56  | 3.377,51  | 7,40  |
| ALSC3  | Exploração de Imóveis           | 3.231,13 | 6,95  | 2.200,00  | 4,82  |
| BBDC4  | Intermediários Financeiros      | 2.545,94 | 5,48  | 3.143,52  | 6,89  |
| PCAR4  | Comércio e Distribuição         | 2.348,06 | 5,05  | 2.162,81  | 4,74  |
| SANB11 | Intermediários Financeiros      | 2.195,72 | 4,72  | 863,73    | 1,89  |
| BRML3  | Exploração de Imóveis           | 2.171,00 | 4,67  | 1.940,72  | 4,25  |
| RAIL3  | Transporte                      | 2.099,95 | 4,52  | 1.961,17  | 4,30  |
| BBAS3  | Intermediários Financeiros      | 2.092,87 | 4,50  | 4.116,89  | 9,02  |

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

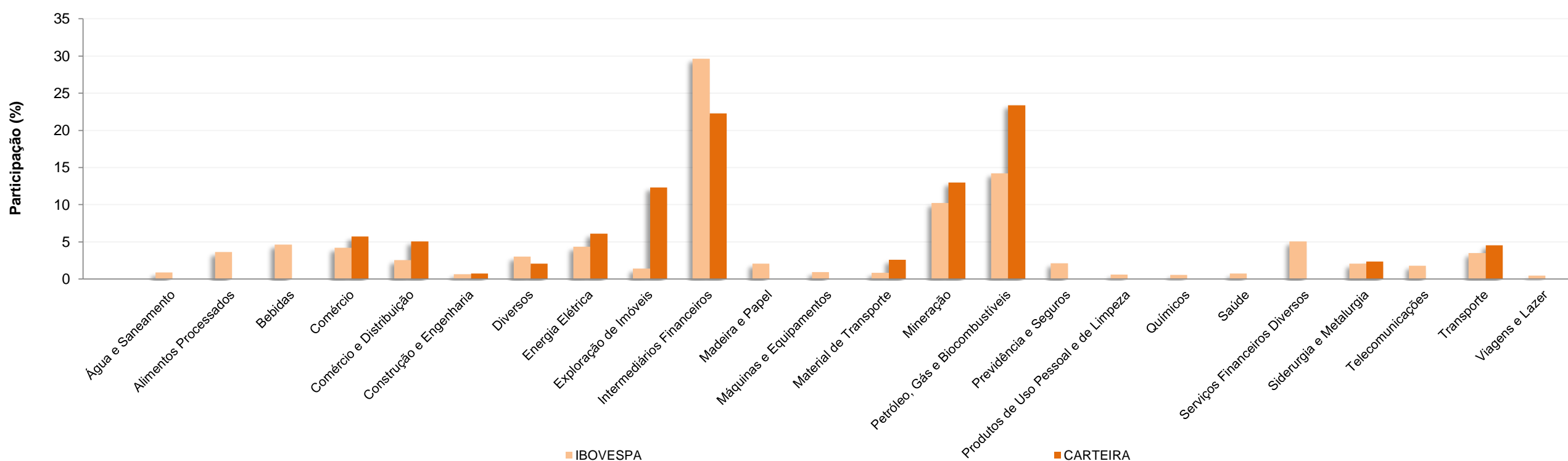
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome   | Valor*   | %     | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|----------|-------|--------------|--------------------|
| JFEN3  | 339,01   | 0,73  | 2,33         | 127                |
| PETR4  | 8.514,61 | 18,32 | 0,01         | 1                  |
| VALE3  | 6.032,37 | 12,98 | 0,00         | 1                  |
| ITSA4  | 3.513,81 | 7,56  | 0,01         | 1                  |
| ALSC3  | 3.231,13 | 6,95  | 0,13         | 1                  |
| BBDC4  | 2.545,94 | 5,48  | 0,00         | 1                  |
| PCAR4  | 2.348,06 | 5,05  | 0,02         | 1                  |
| SANB11 | 2.195,72 | 4,72  | 0,67         | 1                  |
| BRML3  | 2.171,00 | 4,67  | 0,02         | 1                  |
| RAIL3  | 2.099,95 | 4,52  | 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.



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 28/06/2019

## Análises de Contrapartes

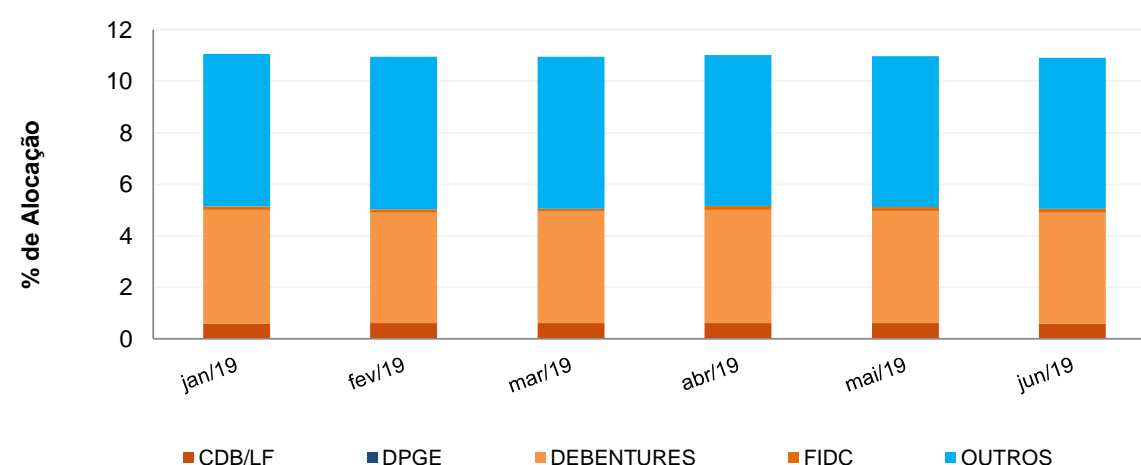
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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      | 11.337,34 | 5,06 |           |         |       |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS  | 9.334,16  | 4,16 | AA (bra)  | Aaa.br  | brAAA |
| CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA      | 8.084,96  | 3,61 | A- (bra)  | Baa2.br | brA+  |
| VALE SA                           | 6.032,37  | 2,69 | AAA (bra) | Aaa.br  | brAAA |
| BCO BRADESCO SA                   | 3.900,75  | 1,74 | AAA (bra) | Aa1.br  | brAAA |
| ITAUSA INVESTS ITAU SA            | 3.516,16  | 1,57 |           | A1.br   |       |
| ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA      | 3.231,13  | 1,44 | AA (bra)  |         |       |
| COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAC | 2.348,06  | 1,05 | AA (bra)  |         | brAA- |
| BCO SANTANDER (BRASIL) SA         | 2.195,72  | 0,98 |           | Aaa.br  | brAAA |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA         | 2.171,00  | 0,97 | AAA (bra) | Aa1.br  |       |

\* 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 | 11.337,34       | RB CAPITAL SECURITIZADORA SA | AA (bra) | AAA (bra) | Fitch   | 20-jun-27 | IPCA   | 6,85% | FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOB |

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base:

28/06/2019

## 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 2020-03-01   | 01-mar-20  | 53.473     | 0,02%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01   | 01-mar-20  | 29.747     | 0,01%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01   | 01-mar-20  | 1.594      | 0,00%           | Selic     | 12-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01   | 01-set-20  | 31.871     | 0,01%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01   | 01-set-20  | 21.247     | 0,01%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01   | 01-set-20  | 12.394     | 0,01%           | Selic     | 14-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-09-01   | 01-set-20  | 5.312      | 0,00%           | Selic     | 14-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01   | 01-mar-21  | 106.232    | 0,05%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01   | 01-mar-21  | 52.939     | 0,02%           | Selic     | 14-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01   | 01-mar-21  | 2.337      | 0,00%           | Selic     | 12-jun-19   | 0,00%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01   | 01-set-21  | 354        | 0,00%           | Selic     | 07-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-09-01   | 01-set-21  | 283        | 0,00%           | Selic     | 12-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-03-01   | 01-mar-22  | 106.217    | 0,05%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2022-03-01   | 01-mar-22  | 3.541      | 0,00%           | Selic     | 14-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01   | 01-mar-23  | 7.080      | 0,00%           | Selic     | 06-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01   | 01-mar-23  | 4.602      | 0,00%           | Selic     | 07-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 15.573     | 0,01%           | Selic     | 10-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 5.309      | 0,00%           | Selic     | 13-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 2.124      | 0,00%           | Selic     | 07-jun-19   | 0,01%      | 0,01%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2024-09-01   | 01-set-24  | 176.907    | 0,08%           | Selic     | 26-jun-19   | 0,02%      | 0,00%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-03-01   | 01-mar-25  | 88.432     | 0,04%           | Selic     | 26-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 20.342.075 | 9,07%           | Selic     | 28-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI MULT FIOPREV            |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 10.171.038 | 4,54%           | Selic     | 28-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI MULT FIOPREV            |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 212.205    | 0,09%           | Selic     | 28-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 212.205    | 0,09%           | Selic     | 28-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 88.419     | 0,04%           | Selic     | 26-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 1.768      | 0,00%           | Selic     | 14-jun-19   | 0,02%      | 0,02%          | BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |

