

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/07/2019

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	156.642.161,97	67,95%			0,69%	3,00%	4,98%	6,09%	10,21%	19,29%	35,18%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,56%	1,56%	4,77%	5,61%	8,48%	18,19%	26,90%
Renda Fixa	156.642.161,97	67,95%		0,43%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	48.121.761,79	20,88%		100%	1,35%	0,71%	-	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21.012.049,92	9,12%	BB	4,61%	0,00%	0,55%	1,53%	2,98%	3,52%	6,11%	13,38%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	55.919.414,29	24,26%	BRADESCO	100%	0,05%	0,57%	1,70%	3,10%	3,71%	6,42%	13,78%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	31.264.157,36	13,56%	BRADESCO	0,33%	0,00%	0,55%	1,54%	3,01%	3,55%	6,17%	13,51%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	179.750,41	0,08%	BRASIL PLURAL	3,33%	0,88%	2,48%	4,86%	5,75%	10,04%	21,93%	41,99%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	17.121,89	0,01%	BRPP	3,01%	0,88%	2,48%	4,86%	5,75%	10,04%	21,93%	41,99%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	127.906,31	0,06%	VILA RICA	1,88%	0,88%	2,48%	4,86%	5,75%	10,04%	21,93%	41,99%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,56%	1,56%	4,77%	5,61%	8,48%	18,19%	26,90%
Renda Variável	51.817.856,90	22,48%			0,36%	7,94%	7,09%	16,54%	28,36%	49,27%	54,03%
Benchmark:	IBOVESPA				0,84%	5,67%	4,54%	15,84%	28,52%	54,45%	77,66%
Renda Variável	51.817.856,90	22,48%		6,14%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	6.726.792,62	2,92%		100%	6,27%	-	-	-	-	-	-
FIOPREV FIA	45.091.064,28	19,56%	QUELUZ	100%	6,51%	1,40%	9,89%	7,83%	18,16%	30,83%	49,55%
Benchmark:	IBOVESPA				0,84%	5,67%	4,54%	15,84%	28,52%	54,45%	77,66%
Imobiliário	22.583.946,82	9,80%			0,06%	4,02%	6,46%	8,37%	14,23%	20,07%	14,01%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,56%	1,56%	4,77%	5,61%	8,48%	18,19%	26,90%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	12.439.691,03	5,40%									
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	12.439.691,03	5,40%		100%	1,60%	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%
Imóveis	5.455.318,46	2,37%									
FII	4.688.937,33	2,03%									
VECTOR LAJES FII	4.688.937,33	2,03%	QUELUZ	6,81%	-4,99%	-1,21%	-0,76%	1,07%	4,86%	9,73%	20,60%
Benchmark:	IFIX				1,27%	6,02%	10,37%	13,10%	23,44%	28,73%	53,29%
Operações com Participantes	527.341,13	0,23%			1,32%	-1,70%	61,09%	61,62%	151,72%	164,41%	209,69%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,56%	1,56%	4,77%	5,61%	8,48%	18,19%	26,90%
Total	230.512.579,23	100%			1,77%	0,55%	4,15%	5,73%	8,62%	14,47%	25,47%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.				0,48%	1,31%	4,28%	5,03%	7,46%	15,98%	23,34%

* 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.

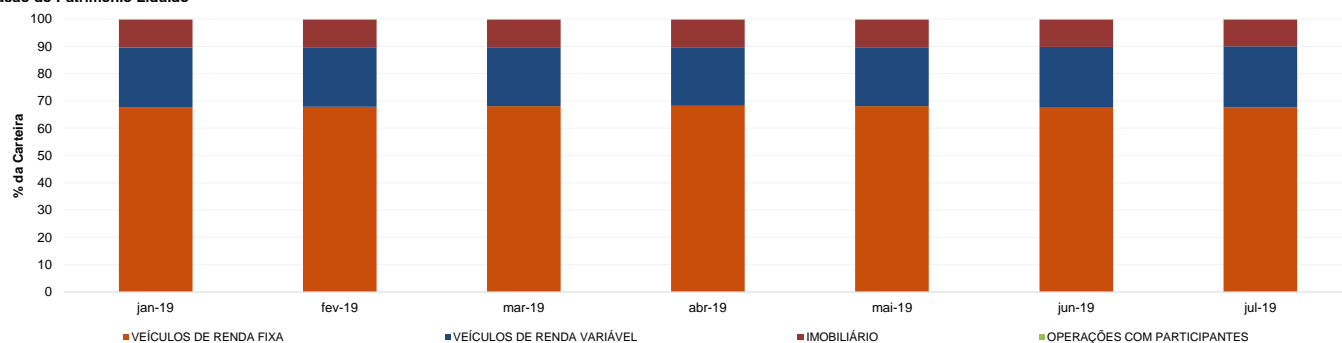
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

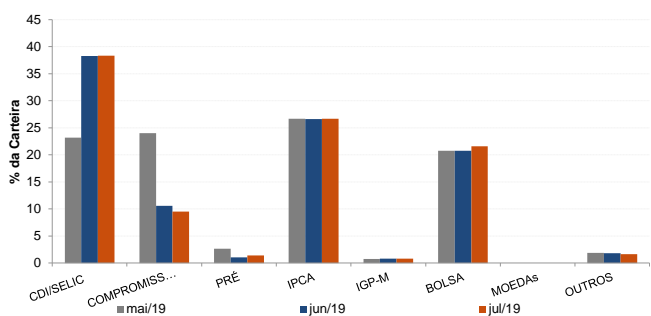
Distribuição da Carteira

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.

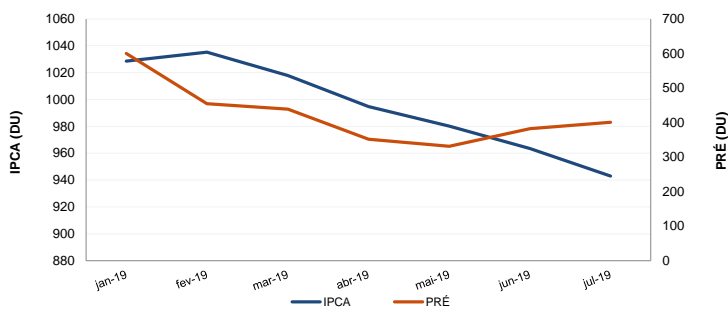
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	7.029,58	14,49	8.514,61	18,32
VALE3	Mineração	5.150,85	10,62	6.032,37	12,98
ALSC3	Exploração de Imóveis	3.704,17	7,63	3.231,13	6,95
BBDC4	Intermediários Financeiros	3.545,22	7,31	2.545,94	5,48
ITSA4	Intermediários Financeiros	2.966,61	6,11	3.513,81	7,56
PCAR4	Comércio e Distribuição	2.320,04	4,78	2.348,06	5,05
BRML3	Exploração de Imóveis	2.274,02	4,69	2.171,00	4,67
RAIL3	Transporte	2.220,50	4,58	2.099,95	4,52
BBAS3	Intermediários Financeiros	1.909,74	3,94	2.092,87	4,50
AZUL4	Transporte	1.672,49	3,45	0,00	0,00

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

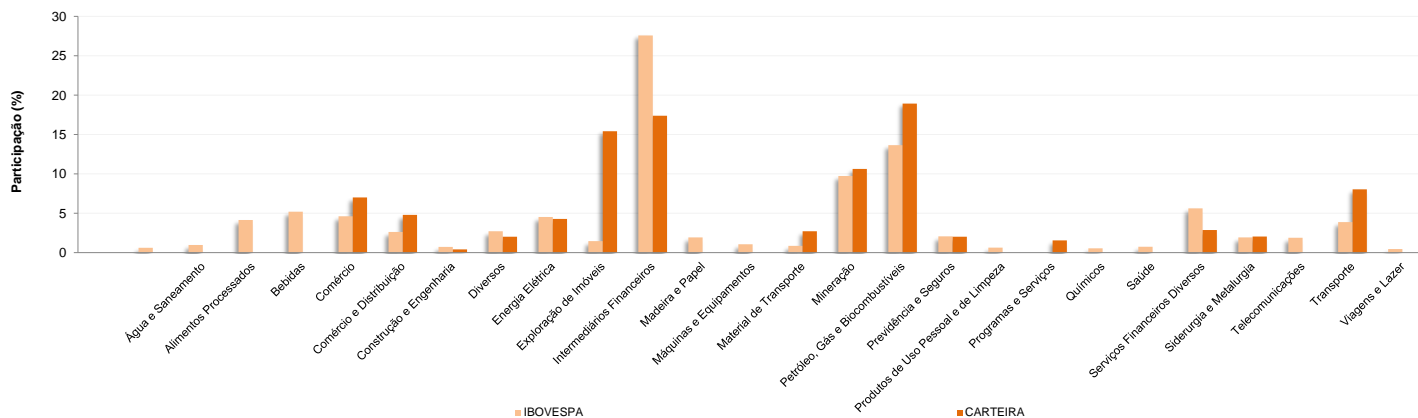
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JFEN3	197,66	0,41	2,33	4
PETR4	7.029,58	14,49	0,01	1
VALE3	5.150,85	10,62	0,00	1
ALSC3	3.704,17	7,63	0,13	1
BBDC4	3.545,22	7,31	0,00	1
ITSA4	2.966,61	6,11	0,01	1
PCAR4	2.320,04	4,78	0,02	1
BRML3	2.274,02	4,69	0,02	1
RAIL3	2.220,50	4,58	0,01	1
BBAS3	1.909,74	3,94	0,00	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.

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/07/2019

Análises de Contrapartes

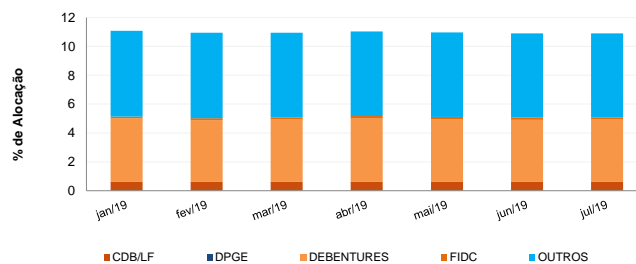
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.305,41	5,02			
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	8.167,93	3,63	A- (bra)	Baa2.br	brA+
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	7.815,54	3,47	AA (bra)		brAAA
VALE SA	5.150,85	2,29	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO BRADESCO SA	4.910,49	2,18	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	3.704,17	1,65	AAA (bra)		
ITAUSA INVESTS ITAU SA	2.968,87	1,32		A1.br	
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	2.320,04	1,03	AA (bra)		brAA-
BR MALLS PARTICIPACOES SA	2.274,02	1,01	AAA (bra)	Aa1.br	
RUMO SA	2.220,50	0,99	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:

31/07/2019

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	159.905	0,07%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	143.504	0,06%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	82.002	0,04%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	37.584	0,02%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	34.168	0,02%	Selic	25-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	23.917	0,01%	Selic	30-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	5.330	0,00%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2.563	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.196	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	478	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	342	0,00%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	342	0,00%	Selic	30-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	308	0,00%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	205	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	205	0,00%	Selic	17-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	171	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	171	0,00%	Selic	22-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	137	0,00%	Selic	18-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	137	0,00%	Selic	23-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	34	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-09-01	01-set-20	102.502	0,05%	Selic	25-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-03-01	01-mar-21	18.791	0,01%	Selic	31-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-03-01	01-mar-21	6.150	0,00%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.025	0,00%	Selic	19-jul-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2022-03-01	01-mar-22	136.644	0,06%	Selic	30-jul-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2024-09-01	01-set-24	42.673	0,02%	Selic	29-jul-19	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA

