

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2019

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado 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 | 162.081.170,39 | 67,10% | | | 1,43% | 2,45% | 5,45% | 11,11% | 11,11% | 20,58% | 34,60% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 1,65% | 3,13% | 4,68% | 9,94% | 9,94% | 19,58% | 28,32% |
| Renda Fixa | 162.081.170,39 | 67,10% | | 0,52% | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF | 47.860.921,75 | 19,81% | | 100% | 1,70% | 1,38% | 2,86% | 4,92% | 10,68% | 10,68% | - |
| BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP | 21.458.655,30 | 8,88% | BB | 4,81% | 0,00% | 0,36% | 1,18% | 2,68% | 5,72% | 5,72% | 12,25% |
| BRADESCO FI MULT FIOPREV | 57.115.824,43 | 23,65% | BRADESCO | 100% | 0,05% | 0,36% | 1,16% | 2,72% | 5,93% | 5,93% | 12,59% |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 35.348.624,57 | 14,63% | BRADESCO | 0,40% | 0,00% | 0,36% | 1,20% | 2,71% | 5,78% | 5,78% | 12,36% |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM | 180.495,29 | 0,07% | BRASIL PLURAL | 3,33% | 0,66% | 2,13% | 4,65% | 9,69% | 9,69% | 20,79% | 37,40% |
| FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM | 18.667,51 | 0,01% | BRPP | 3,01% | 0,66% | 2,13% | 4,65% | 9,69% | 9,69% | 20,79% | 37,40% |
| FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN | 97.981,55 | 0,04% | VILA RICA | 1,88% | 0,66% | 2,13% | 4,65% | 9,69% | 9,69% | 20,79% | 37,40% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 1,65% | 3,13% | 4,68% | 9,94% | 9,94% | 19,58% | 28,32% |
| Renda Variável | 59.027.316,65 | 24,44% | | | 7,81% | 12,90% | 14,80% | 33,31% | 33,31% | 55,86% | 77,19% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | 6,85% | 10,41% | 14,54% | 31,58% | 31,58% | 51,36% | 92,02% |
| Renda Variável | 59.027.316,65 | 24,44% | | 4,96% | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV | 7.352.818,02 | 3,04% | | 100% | 6,16% | - | - | - | - | - | - |
| FIOPREV FIA | 51.674.498,63 | 21,39% | QUELUZ | 100% | 5,30% | 8,29% | 13,24% | 16,20% | 35,42% | 35,42% | 56,49% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | 6,85% | 10,41% | 14,54% | 31,58% | 31,58% | 51,36% | 92,02% |
| Imobiliário | 20.792.423,44 | 8,61% | | | -2,36% | 1,38% | 3,50% | 12,10% | 12,10% | 20,89% | 14,53% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 1,65% | 3,13% | 4,68% | 9,94% | 9,94% | 19,58% | 28,32% |
| CARTEIRA PRÓPRIA IM | 12.166.566,50 | 5,04% | | | | | | | | | |
| FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/ | 12.166.566,50 | 5,04% | | 100% | 2,16% | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,38% | 1,24% | 2,81% | 5,97% | 5,97% | 12,77% | 24,00% |
| Imóveis | 5.396.357,15 | 2,23% | | | | | | | | | |
| FII | 3.229.499,79 | 1,34% | | | | | | | | | |
| VECTOR LAJES FII | 3.229.499,79 | 1,34% | QUELUZ | 12,20% | -17,52% | -32,78% | -35,33% | -31,21% | -31,21% | -26,30% | -20,68% |
| Benchmark: | IFIX | | | | 10,63% | 19,12% | 21,76% | 35,98% | 35,98% | 43,62% | 71,54% |
| Operações com Participantes | 540.638,24 | 0,22% | | | -1,81% | 0,02% | 5,50% | 68,30% | 68,30% | 107,31% | 171,94% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 1,65% | 3,13% | 4,68% | 9,94% | 9,94% | 19,58% | 28,32% |
| Total | 241.551.330,01 | 100% | | | 1,61% | 2,52% | 4,69% | 7,38% | 15,99% | 15,99% | 27,84% |
| Benchmark: | INPC + 4.2% a.a. | | | | 1,57% | 2,88% | 4,17% | 8,89% | 8,89% | 17,32% | 24,71% |

* As rentabilidades dos fundos de investimentos foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

- O valor Total apresentado é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

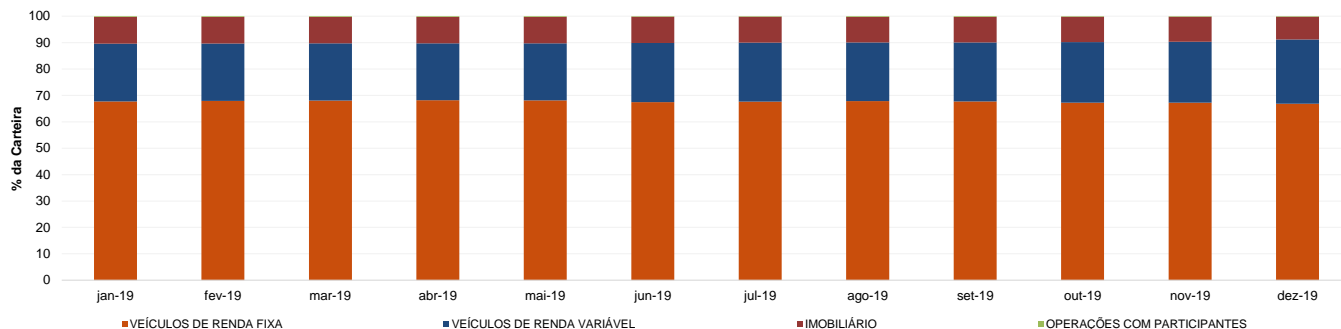
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

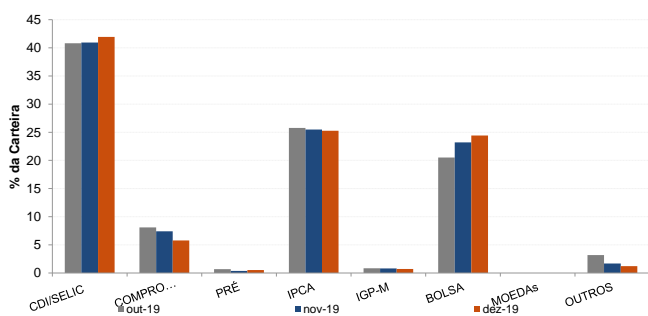
Distribuição da Carteira

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.

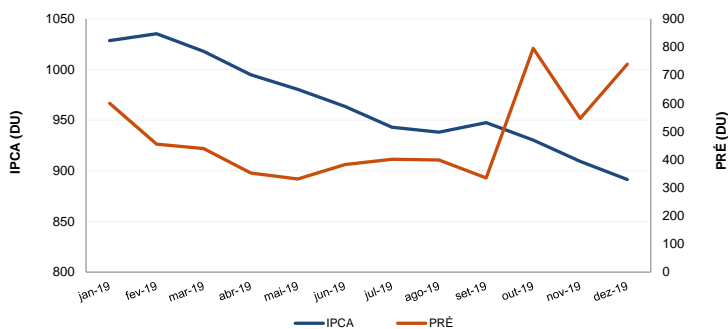
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 9.598,42 | 16,64 | 7.833,74 | 14,60 |
| VALE3 | Mineração | 5.218,60 | 9,05 | 6.547,88 | 12,21 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 4.548,25 | 7,88 | 0,00 | |
| HAPV3 | Análises e Diagnósticos | 3.546,45 | 6,15 | 0,00 | |
| GOAU4 | Siderurgia e Metalurgia | 3.437,31 | 5,96 | 2.889,12 | 5,39 |
| B3SA3 | Serviços Financeiros Diversos | 2.844,61 | 4,93 | 1.894,48 | 3,53 |
| HGTX3 | Tecidos, Vestuário e Calçados | 2.757,24 | 4,78 | 2.596,86 | 4,84 |
| BRML3 | Exploração de Imóveis | 2.755,96 | 4,78 | 2.375,98 | 4,43 |
| JBSS3 | Alimentos Processados | 2.510,34 | 4,35 | 0,00 | |
| RENT3 | Diversos | 2.274,97 | 3,94 | 2.531,25 | 4,72 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

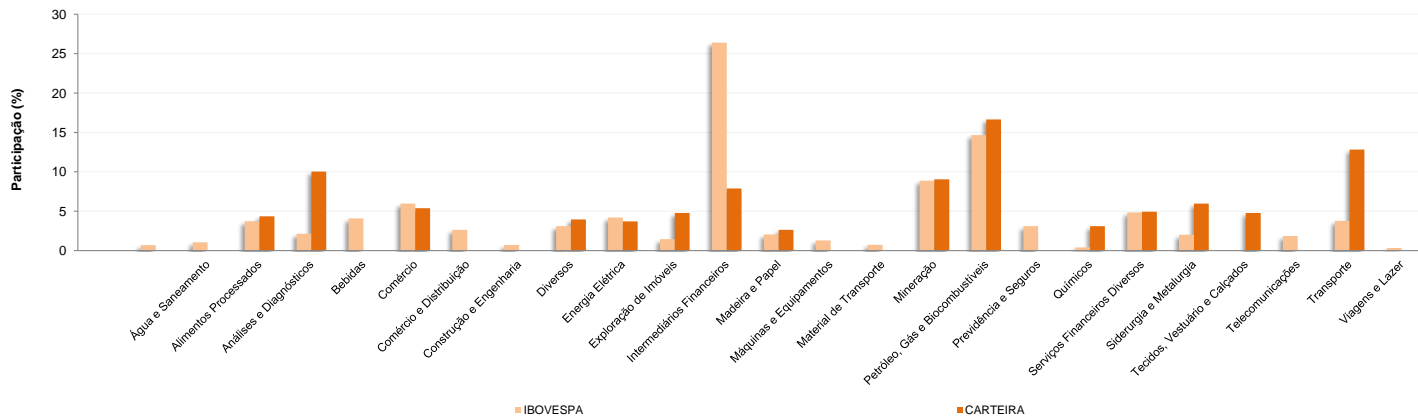
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|-------|--------------|--------------------|
| PETR4 | 9.598,42 | 16,64 | 0,01 | 1 |
| VALE3 | 5.218,60 | 9,05 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 4.548,25 | 7,88 | 0,01 | 1 |
| HAPV3 | 3.546,45 | 6,15 | 0,03 | 1 |
| GOAU4 | 3.437,31 | 5,96 | 0,06 | 1 |
| B3SA3 | 2.844,61 | 4,93 | 0,00 | 1 |
| HGTX3 | 2.757,24 | 4,78 | 0,06 | 1 |
| BRML3 | 2.755,96 | 4,78 | 0,02 | 1 |
| JBSS3 | 2.510,34 | 4,35 | 0,01 | 1 |
| RENT3 | 2.274,97 | 3,94 | 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.

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/12/2019

Análises de Contrapartes

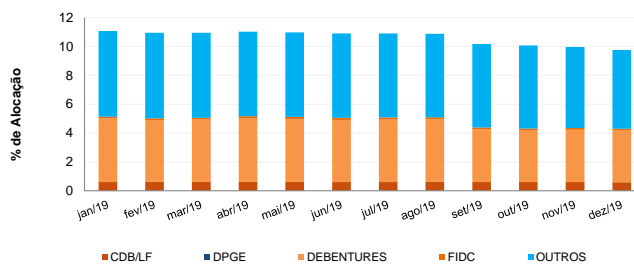
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emisoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|-----------------------------------|-----------|------|-----------|---------|-------|
| RB CAPITAL SECURITIZADORA SA | 11.164,20 | 4,73 | | | |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 9.598,42 | 4,06 | AA (bra) | | brAAA |
| CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA | 8.447,67 | 3,58 | A+ (bra) | Baa2.br | brA+ |
| VALE SA | 5.218,60 | 2,21 | AAA (bra) | Aaa.br | brAAA |
| ITAUSA INVESTS ITAU SA | 4.548,25 | 1,93 | | A1.br | |
| HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENT | 3.546,45 | 1,50 | AAA (bra) | | |
| METALURGICA GERDAU SA | 3.437,31 | 1,46 | AA+ (bra) | | |
| B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO | 2.844,61 | 1,20 | | Aaa.br | |
| CIA HERING (EX HERING TEXTIL SA) | 2.757,24 | 1,17 | | | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 2.755,96 | 1,17 | 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. As alterações são chegadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

| Títulos Privados | Valor (mil R\$) | Contraparte | Anterior | Atual | Agência | Venc. | Index. | Taxa | Veículo |
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|

Nenhuma mudança de rating encontrada.

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base:

31/12/2019

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.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota do emissor.

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|-----------|-----------------|-----------|-------------|--------------|----------------|-------------------------------------|
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 12.062 | 0,01% | Selic | 17-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 1.497 | 0,00% | Selic | 02-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 1.289 | 0,00% | Selic | 24-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 873 | 0,00% | Selic | 02-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 790 | 0,00% | Selic | 31-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 707 | 0,00% | Selic | 27-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 624 | 0,00% | Selic | 26-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 582 | 0,00% | Selic | 27-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 416 | 0,00% | Selic | 06-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 333 | 0,00% | Selic | 06-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 333 | 0,00% | Selic | 06-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 333 | 0,00% | Selic | 17-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 291 | 0,00% | Selic | 06-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 250 | 0,00% | Selic | 31-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 250 | 0,00% | Selic | 09-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 250 | 0,00% | Selic | 11-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 250 | 0,00% | Selic | 27-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 208 | 0,00% | Selic | 02-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 208 | 0,00% | Selic | 20-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 208 | 0,00% | Selic | 30-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 166 | 0,00% | Selic | 05-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 166 | 0,00% | Selic | 12-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 166 | 0,00% | Selic | 17-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 125 | 0,00% | Selic | 02-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 125 | 0,00% | Selic | 16-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 125 | 0,00% | Selic | 19-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 125 | 0,00% | Selic | 30-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 83 | 0,00% | Selic | 06-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 83 | 0,00% | Selic | 09-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 83 | 0,00% | Selic | 13-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 83 | 0,00% | Selic | 26-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 42 | 0,00% | Selic | 13-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1.039.744 | 0,44% | Selic | 05-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 207.949 | 0,09% | Selic | 05-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 95.656 | 0,04% | Selic | 19-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 49.908 | 0,02% | Selic | 30-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 41.590 | 0,02% | Selic | 27-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 41.590 | 0,02% | Selic | 30-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 28.281 | 0,01% | Selic | 20-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 12.477 | 0,01% | Selic | 26-dez-19 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 252.160 | 0,11% | Selic | 10-dez-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 40.325 | 0,02% | Selic | 13-dez-19 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 199.506 | 0,08% | Selic | 27-dez-19 | 0,02% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA |