

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/09/2020

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>166.812.680,51</b>	<b>70,98%</b>				<b>-0,11%</b>	<b>1,06%</b>	<b>4,17%</b>	<b>4,44%</b>	<b>7,00%</b>	<b>19,88%</b>	<b>27,85%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,30%	3,02%	4,10%	5,98%	9,29%	18,31%	29,33%
<b>Renda Fixa</b>	<b>166.812.680,51</b>	<b>70,98%</b>			<b>0,46%</b>							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	44.925.768,04	19,12%		100%	1,75%	-0,11%	1,06%	5,94%	5,27%	6,81%	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	21.863.229,07	9,30%	BB	4,92%	0,13%	-0,05%	0,26%	0,94%	1,89%	3,09%	9,31%	16,33%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59.304.155,45	25,23%	BRADESCO	100%	0,09%	0,09%	0,41%	1,46%	2,43%	3,62%	10,44%	17,26%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	39.852.654,97	16,96%	BRADESCO	0,54%	0,14%	-0,03%	0,30%	0,99%	1,95%	3,17%	9,45%	16,54%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	82.089,36	0,03%	BRASIL PLURAL	3,33%		0,44%	1,41%	3,01%	4,94%	7,18%	17,88%	30,08%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	16.921,62	0,01%	BRPP	3,01%		0,44%	1,41%	3,01%	4,94%	7,18%	17,88%	30,08%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	767.861,99	0,33%	VILA RICA	1,88%		0,44%	1,41%	3,01%	4,94%	7,18%	17,88%	30,08%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,30%	3,02%	4,10%	5,98%	9,29%	18,31%	29,33%
<b>Renda Variável</b>	<b>48.980.369,35</b>	<b>20,84%</b>				<b>-4,64%</b>	<b>2,64%</b>	<b>32,92%</b>	<b>-16,68%</b>	<b>-5,94%</b>	<b>24,13%</b>	<b>31,10%</b>
Benchmark:	IBOVESPA					-4,80%	-0,48%	29,56%	-18,20%	-9,68%	19,23%	27,34%
<b>Renda Variável</b>	<b>48.980.369,35</b>	<b>20,84%</b>			<b>13,54%</b>							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	5.920.963,89	2,52%		100%	11,31%	-4,46%	-0,84%	41,19%	-16,71%	-	-	-
FIOPREV FIA	43.059.405,46	18,32%	QUELUZ	100%	13,94%	-4,67%	3,15%	31,84%	-16,67%	-5,64%	28,99%	30,51%
Benchmark:	IBOVESPA					-4,80%	-0,48%	29,56%	-18,20%	-9,68%	19,23%	27,34%
<b>Imobiliário</b>	<b>18.773.537,26</b>	<b>7,99%</b>				<b>0,10%</b>	<b>2,17%</b>	<b>3,48%</b>	<b>4,81%</b>	<b>6,26%</b>	<b>23,20%</b>	<b>28,65%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,30%	3,02%	4,10%	5,98%	9,29%	18,31%	29,33%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA IM</b>	<b>11.379.554,03</b>	<b>4,84%</b>										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	11.379.554,03	4,84%		100%	1,88%	-0,05%	2,42%	3,58%	5,17%	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%
<b>Imóveis</b>	<b>5.364.951,80</b>	<b>2,28%</b>				<b>0,38%</b>	<b>1,14%</b>	<b>2,30%</b>	<b>3,94%</b>			
<b>FII</b>	<b>2.029.031,43</b>	<b>0,86%</b>										
VECTOR LAJES FII	2.029.031,43	0,86%	QUELUZ	12,20%		0,25%	1,98%	4,66%	4,10%	-30,03%	-26,56%	-23,59%
Benchmark:	IFIX					0,46%	-0,41%	12,06%	-12,59%	4,12%	30,92%	25,84%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>469.747,93</b>	<b>0,20%</b>				<b>-3,38%</b>	<b>-1,68%</b>	<b>-7,71%</b>	<b>-13,02%</b>	<b>-13,00%</b>	<b>108,08%</b>	<b>147,66%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1,30%	3,02%	4,10%	5,98%	9,29%	18,31%	29,33%
<b>Total</b>	<b>235.027.977,40</b>	<b>100%</b>			<b>3,24%</b>	<b>-1,08%</b>	<b>1,47%</b>	<b>8,95%</b>	<b>-0,65%</b>	<b>4,01%</b>	<b>21,22%</b>	<b>29,00%</b>
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1,22%	2,76%	3,60%	5,22%	8,25%	16,08%	25,70%

\* 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.

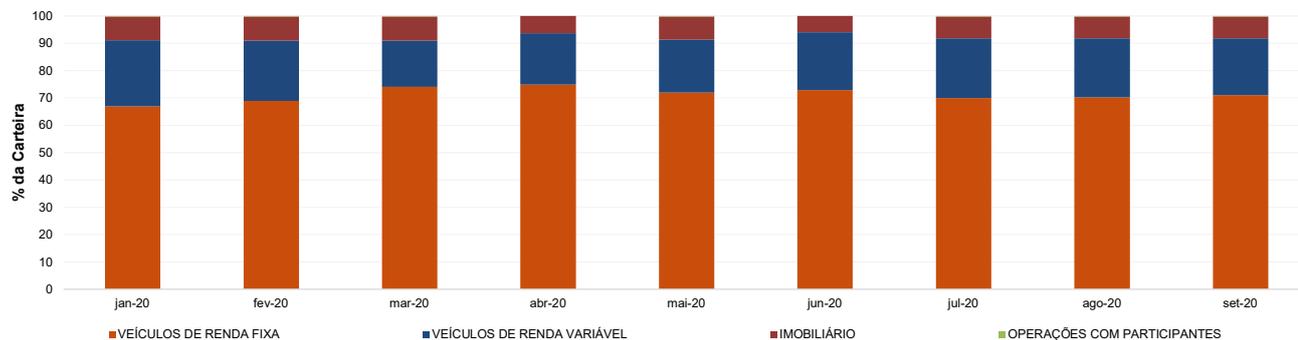
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

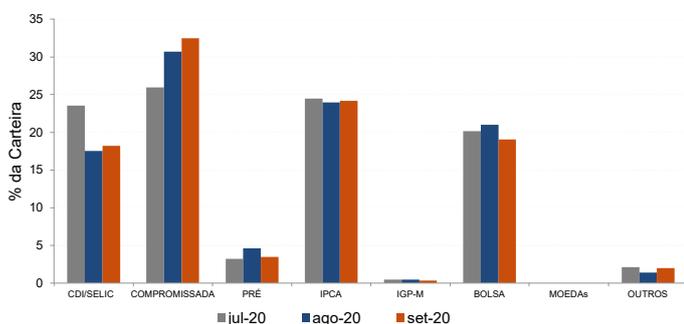
## Distribuição da Carteira

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.

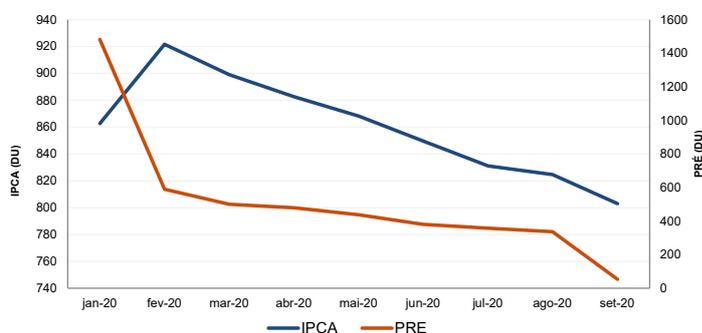
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
VALE3	Mineração	6.733,22	14,62	6.798,15	13,57
MGLU3	Comércio	3.746,40	8,13	2.144,06	4,28
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	3.392,48	7,36	2.080,81	4,15
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3.377,61	7,33	2.598,96	5,19
BTOW3	Comércio	3.176,29	6,90	3.452,37	6,89
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.159,94	6,86	5.392,36	10,76
QUAL3	Análises e Diagnósticos	2.511,86	5,45	2.308,64	4,61
BPAC11	Intermediários Financeiros	2.484,19	5,39	1.333,48	2,66
VVAR3	Comércio	2.402,98	5,22	1.855,25	3,70
WEGE3	Máquinas e Equipamentos	2.220,66	4,82	1.305,32	2,61

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

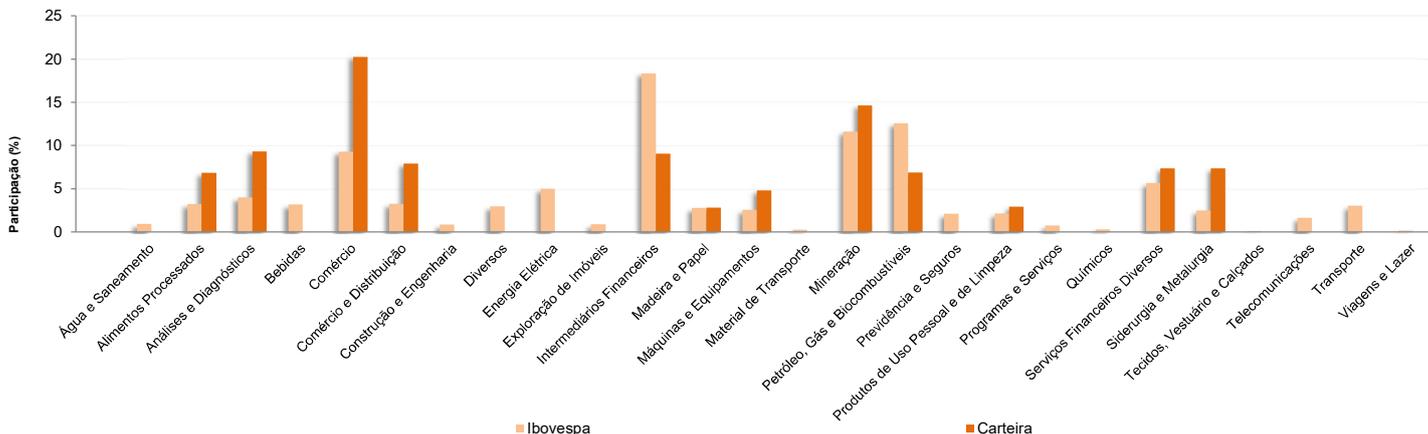
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	6.733,22	14,62	0,00	1
MGLU3	3.746,40	8,13	0,01	1
GGBR4	3.392,48	7,36	0,02	1
B3SA3	3.377,61	7,33	0,00	1
BTOW3	3.176,29	6,90	0,02	1
PETRA	3.159,94	6,86	0,00	1
QUAL3	2.511,86	5,45	0,03	1
BPAC11	2.484,19	5,39	0,00	1
VVAR3	2.402,98	5,22	0,01	1
WEGE3	2.220,66	4,82	0,00	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

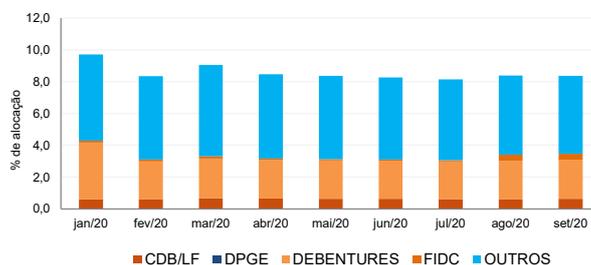
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
RB CAPITAL SECURITIZADORA SA	10.400,89	4,54	Sem Faixa
VALE SA	6.733,22	2,94	Faixa 1
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	5.623,17	2,46	Faixa 3
MAGAZINE LUIZA SA	3.746,40	1,64	Faixa 1
GERDAU SA	3.392,48	1,48	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3.377,61	1,48	Faixa 1
B2W CIA DIGITAL	3.176,29	1,39	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	3.159,94	1,38	Faixa 2
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SI	2.511,86	1,10	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	2.484,19	1,09	Faixa 2

\* em mil R\$

### Alocação Por Tipo de Crédito



## Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/09/2020

## 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.

É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	362.102	0,16%	Selic	23-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	201.168	0,09%	Selic	03-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.207	0,00%	Selic	01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	977	0,00%	Selic	01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	920	0,00%	Selic	08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	575	0,00%	Selic	04-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	575	0,00%	Selic	08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	402	0,00%	Selic	01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	402	0,00%	Selic	11-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	345	0,00%	Selic	23-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	287	0,00%	Selic	09-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	230	0,00%	Selic	17-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	172	0,00%	Selic	15-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	172	0,00%	Selic	21-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	172	0,00%	Selic	01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	115	0,00%	Selic	08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	413.620	0,18%	Selic	03-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	383.001	0,17%	Selic	23-set-20	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	258.513	0,11%	Selic	08-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	191.472	0,08%	Selic	28-set-20	7,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	191.472	0,08%	Selic	28-set-20	7,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	166.485	0,07%	Selic	28-set-20	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	95.595	0,04%	Selic	28-set-20	0,09%	0,09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	382.046	0,17%	Selic	23-set-20	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	229.216	0,10%	Selic	28-set-20	0,12%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	95.306	0,04%	Selic	23-set-20	0,10%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	475.647	0,21%	Selic	23-set-20	0,09%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	567.892	0,25%	Selic	04-set-20	4,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	170.063	0,07%	Selic	10-set-20	4,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

