

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/05/2021

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	234,805,281.07	95.87%				14.15%	14.87%	15.46%	14.55%	18.20%	28.03%	40.56%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.39%	3.54%	7.49%	5.47%	14.54%	22.94%	35.49%
Renda Fixa	234,805,281.07	95.87%			0.46%							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	40,013,145.43	16.34%		100%	2.07%	1.05%	2.28%	1.88%	1.09%	5.09%	12.38%	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,154,727.93	9.05%	BB	3.40%	0.06%	0.28%	0.58%	1.04%	0.82%	1.80%	6.49%	13.03%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	59,952,166.87	24.48%	BRADESCO	100%	0.37%	0.29%	0.64%	0.84%	0.61%	1.75%	6.91%	13.66%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	111,687,093.48	45.60%	BRADESCO	0.70%	0.06%	0.28%	0.60%	1.05%	0.84%	1.78%	6.53%	13.13%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	65,741.95	0.03%	BRASIL PLURAL	0.00%		0.56%	1.56%	2.85%	2.38%	5.74%	14.77%	26.34%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	12,544.26	0.01%	BRPP	0.00%		0.56%	1.56%	2.85%	2.38%	5.74%	14.77%	26.34%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	919,861.15	0.38%	VILA RICA	0.00%		0.56%	1.56%	2.85%	2.38%	5.74%	14.77%	26.34%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.39%	3.54%	7.49%	5.47%	14.54%	22.94%	35.49%
Renda Variável	2,746,115.98	1.12%				4.86%	10.95%	7.02%	2.01%	33.83%	22.42%	51.07%
Benchmark:	IBOVESPA					6.16%	14.70%	15.91%	6.05%	44.41%	30.08%	64.44%
Renda Variável	2,746,115.98	1.12%			6.02%							
FIOPREV FIA	2,746,115.98	1.12%	QUELUZ	100%	6.02%	6.35%	11.39%	6.02%	2.31%	30.96%	20.33%	49.17%
Benchmark:	IBOVESPA					6.16%	14.70%	15.91%	6.05%	44.41%	30.08%	64.44%
Imobiliário	6,948,391.70	2.84%				-4.22%	-2.13%	-3.49%	-2.78%	0.75%	9.33%	25.00%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.39%	3.54%	7.49%	5.47%	14.54%	22.94%	35.49%
Imóveis	4,766,752.13	1.95%				-0.11%	-0.17%	-10.38%	-0.28%	-8.95%		
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1,115,182.86	0.46%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARIZ	1,115,182.86	0.46%		100%	4.56%	-8.49%	-5.91%	-71.27%	-72.19%	-70.15%	-	-
Benchmark:	CDI					0.27%	0.67%	1.13%	0.96%	2.18%	7.17%	14.00%
FII	1,066,456.71	0.44%										
VECTOR LAJES FII	1,066,456.71	0.44%	QUELUZ	9.98%		144.56%	-6.14%	-6.20%	-7.96%	-2.53%	-34.48%	-28.06%
Benchmark:	IFIX					-1.56%	-2.43%	0.28%	-1.87%	5.97%	10.33%	27.21%
Operações com Participantes	385,411.41	0.16%				-5.66%	-5.34%	-10.50%	-8.96%	-9.10%	-14.39%	118.36%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.39%	3.54%	7.49%	5.47%	14.54%	22.94%	35.49%
Total	244,927,228.83	100%			0.52%	11.53%	13.63%	12.97%	11.18%	20.83%	26.35%	43.01%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.31%	3.29%	6.98%	5.07%	13.45%	20.62%	31.68%

* 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.

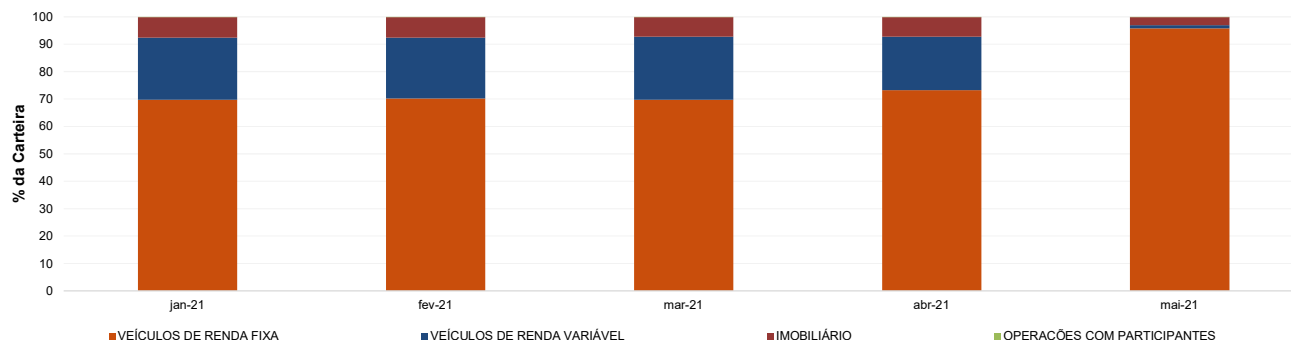
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

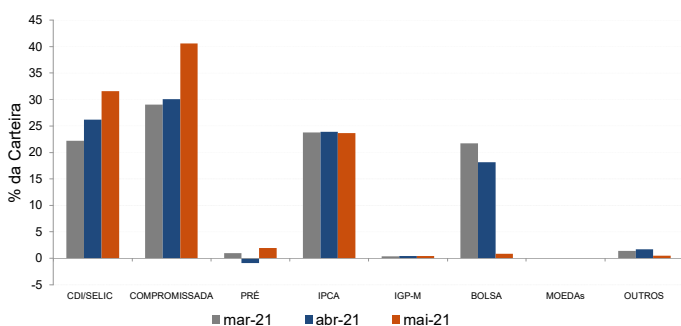
Distribuição da Carteira

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.

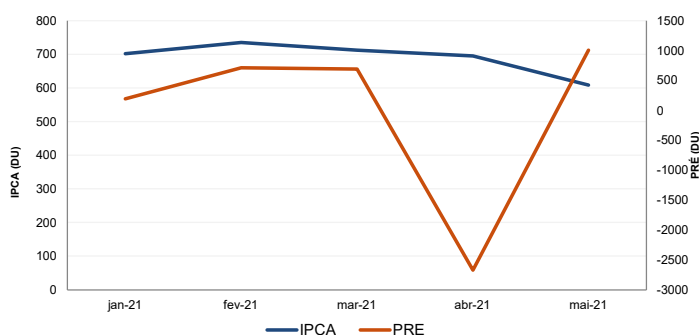
Evolução do Patrimônio Líquido



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	309.91	14.53	5,211.16	11.52
ITUB4	Intermediários Financeiros	197.92	9.28	3,339.39	7.38
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	184.35	8.64	2,388.52	5.28
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	173.65	8.14	3,090.00	6.83
ABEV3	Bebidas	170.52	8.00	2,593.58	5.73
BBDC4	Intermediários Financeiros	157.82	7.40	2,572.46	5.69
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	155.85	7.31	2,503.72	5.54
BPAC11	Intermediários Financeiros	136.73	6.41	2,133.45	4.72
LREN3	Comércio	131.04	6.14	1,571.56	3.47
IGTA3	Exploração de Imóveis	129.75	6.08	1,994.56	4.41

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

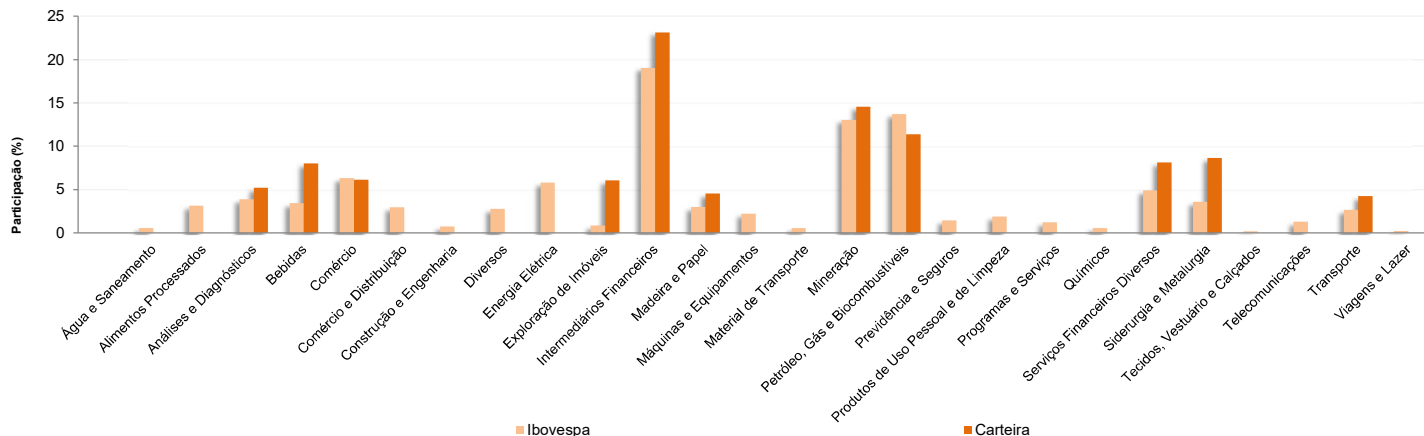
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	309.91	14.53	0.00	1
ITUB4	197.92	9.28	0.00	1
GGBR4	184.35	8.64	0.00	1
B3SA3	173.65	8.14	0.00	1
ABEV3	170.52	8.00	0.00	1
BBDC4	157.82	7.40	0.00	1
PETR4	155.85	7.31	0.00	1
BPAC11	136.73	6.41	0.00	1
LREN3	131.04	6.14	0.00	1
IGTA3	129.75	6.08	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

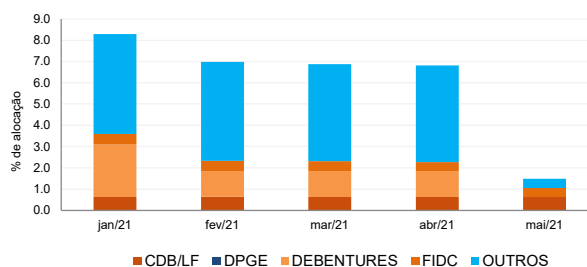
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	1,665.93	0.69	Faixa 2
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,061.89	0.44	Sem Faixa
VALE SA	309.91	0.13	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	197.92	0.08	Faixa 1
GERDAU SA	184.35	0.08	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	173.65	0.07	Sem Faixa
AMBEV S.A	170.52	0.07	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	155.85	0.07	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	136.73	0.06	Faixa 2
LOJAS RENNEN SA	131.04	0.05	Faixa 1

* 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: 31/05/2021

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 2021-09-01	01-set-21	137,551	0.06%	Selic	14-mai-21	0.09%	0.09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	534,640	0.22%	Selic	04-mai-21	0.09%	0.09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	763,335	0.32%	Selic	31-mai-21	0.11%	0.11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	381,305	0.16%	Selic	31-mai-21	0.13%	0.13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1,898,514	0.79%	Selic	13-mai-21	0.25%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	759,406	0.32%	Selic	13-mai-21	0.25%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	759,406	0.32%	Selic	13-mai-21	0.25%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	34,173	0.01%	Selic	19-mai-21	0.24%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	1,516,583	0.63%	Selic	13-mai-21	0.26%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	758,291	0.32%	Selic	31-mai-21	0.25%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1,891,529	0.79%	Selic	13-mai-21	0.31%	0.31%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	756,612	0.32%	Selic	31-mai-21	0.27%	0.27%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	566,591	0.24%	Selic	31-mai-21	0.28%	0.28%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	377,727	0.16%	Selic	31-mai-21	0.28%	0.28%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	377,727	0.16%	Selic	31-mai-21	0.28%	0.28%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	942,288	0.39%	Selic	13-mai-21	0.33%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	942,288	0.39%	Selic	31-mai-21	0.29%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	375,244	0.16%	Selic	13-mai-21	0.34%	0.34%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	6,435,356	2.68%	IPCA	19-mai-21	1.28%	1.35%	BRADESCO FI MULT FIOPREV
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2,813,332	1.17%	IPCA	28-mai-21	1.35%	1.28%	BRADESCO FI MULT FIOPREV
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2,809,536	1.17%	IPCA	21-mai-21	1.34%	1.29%	BRADESCO FI MULT FIOPREV
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	186,037	0.08%	IPCA	28-mai-21	1.34%	1.28%	BRADESCO FI MULT FIOPREV

