

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/06/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>234,848,813.84</b>	<b>95.88%</b>				<b>0.15%</b>	<b>14.88%</b>	<b>14.72%</b>	<b>14.72%</b>	<b>17.79%</b>	<b>26.82%</b>	<b>40.21%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.03%	3.23%	6.56%	6.56%	14.88%	23.71%	34.38%
<b>Renda Fixa</b>	<b>234,848,813.84</b>	<b>95.88%</b>			<b>0.33%</b>							
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	39,890,089.66	16.28%		100%	1.47%	-0.19%	55.28%	53.79%	53.79%	57.89%	-	-
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,221,476.08	9.07%	BB	3.44%	0.05%	0.30%	0.72%	1.12%	1.12%	1.91%	6.33%	12.80%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	60,111,507.95	24.54%	BRADESCO	100%	0.30%	0.27%	0.81%	0.88%	0.88%	1.78%	6.65%	13.49%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	111,630,899.09	45.57%	BRADESCO	0.80%	0.06%	0.31%	0.72%	1.15%	1.15%	1.89%	6.38%	12.91%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	64,343.32	0.03%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.59%	1.64%	2.98%	2.98%	5.83%	14.61%	26.07%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	11,575.58	0.00%	BRPP	3.01%		0.59%	1.64%	2.98%	2.98%	5.83%	14.61%	26.07%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	918,922.15	0.38%	VILA RICA	0.00%		0.59%	1.64%	2.98%	2.98%	5.83%	14.61%	26.07%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.03%	3.23%	6.56%	6.56%	14.88%	23.71%	34.38%
<b>Renda Variável</b>	<b>2,702,946.73</b>	<b>1.10%</b>				<b>-1.57%</b>	<b>4.21%</b>	<b>0.40%</b>	<b>0.40%</b>	<b>22.40%</b>	<b>14.06%</b>	<b>55.54%</b>
Benchmark:	IBOVESPA					0.46%	8.72%	6.54%	6.54%	33.40%	25.59%	74.27%
<b>Renda Variável</b>	<b>2,702,946.73</b>	<b>1.10%</b>			<b>4.68%</b>							
FIOPREV FIA	2,702,946.73	1.10%	QUELUZ	100%	4.68%	-1.57%	5.25%	0.70%	0.70%	19.46%	12.14%	52.66%
Benchmark:	IBOVESPA					0.46%	8.72%	6.54%	6.54%	33.40%	25.59%	74.27%
<b>Imobiliário</b>	<b>6,988,408.22</b>	<b>2.85%</b>				<b>0.86%</b>	<b>-1.67%</b>	<b>-1.95%</b>	<b>-1.95%</b>	<b>1.97%</b>	<b>8.27%</b>	<b>25.67%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.03%	3.23%	6.56%	6.56%	14.88%	23.71%	34.38%
<b>Imóveis</b>	<b>4,764,102.54</b>	<b>1.94%</b>				<b>-0.06%</b>	<b>-0.17%</b>	<b>-0.33%</b>	<b>-0.33%</b>	<b>-9.36%</b>		
<b>CARTEIRA PRÓPRIA IM</b>	<b>1,140,396.44</b>	<b>0.47%</b>										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI	1,140,396.44	0.47%		100%	2.97%	4.07%	-2.52%	-71.06%	-71.06%	-68.69%	-	-
Benchmark:	CDI					0.30%	0.78%	1.27%	1.27%	2.27%	6.99%	13.75%
<b>FII</b>	<b>1,083,909.24</b>	<b>0.44%</b>										
VECTOR LAJES FII	1,083,909.24	0.44%	QUELUZ	0.00%		1.64%	1.97%	-6.45%	-6.45%	-1.22%	-34.80%	-26.99%
Benchmark:	IFIX					-2.19%	-3.23%	-4.02%	-4.02%	-1.83%	4.90%	29.63%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>369,100.53</b>	<b>0.15%</b>				<b>-1.48%</b>	<b>-5.79%</b>	<b>-10.31%</b>	<b>-10.31%</b>	<b>-8.39%</b>	<b>-14.49%</b>	<b>116.23%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.03%	3.23%	6.56%	6.56%	14.88%	23.71%	34.38%
<b>Total</b>	<b>244,951,178.67</b>	<b>100%</b>			<b>0.35%</b>	<b>0.15%</b>	<b>12.46%</b>	<b>11.35%</b>	<b>11.35%</b>	<b>18.86%</b>	<b>23.86%</b>	<b>44.01%</b>
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					0.95%	2.99%	6.06%	6.06%	13.79%	21.37%	30.60%

\* 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.

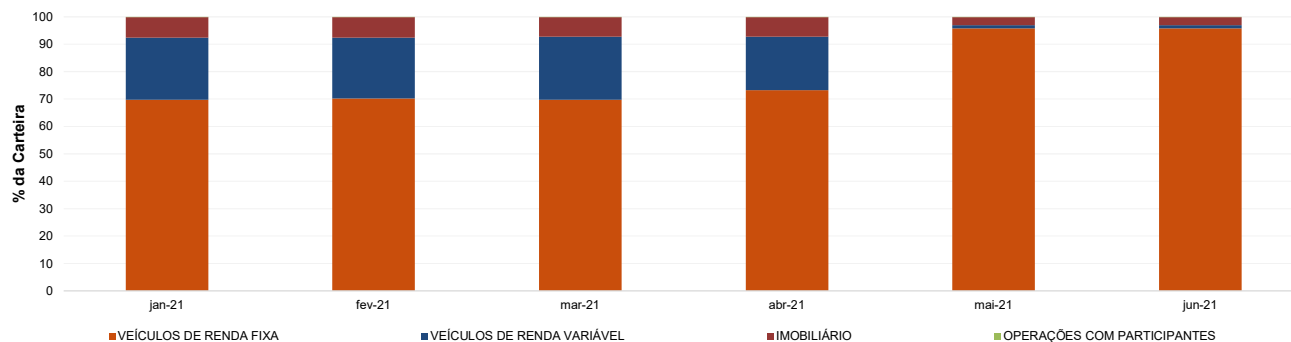
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

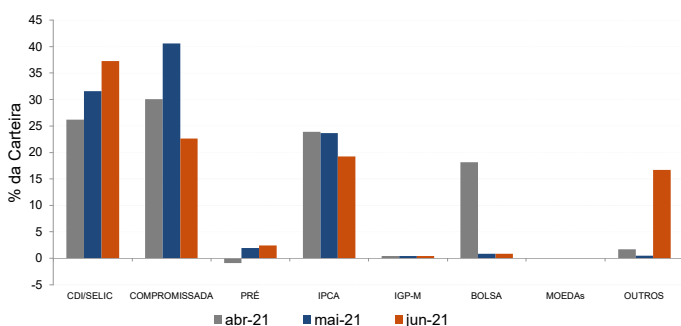
## Distribuição da Carteira

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.

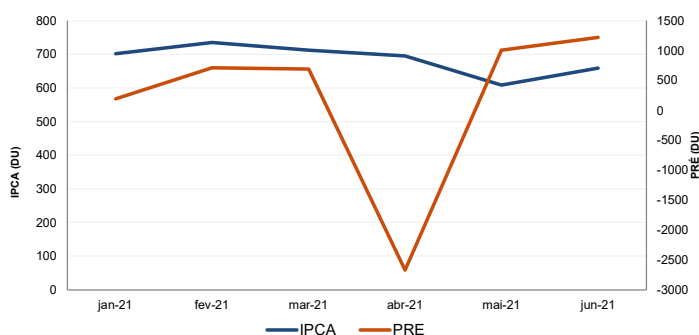
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	305.77	14.65	309.91	14.53
ITUB4	Intermediários Financeiros	199.66	9.57	197.92	9.28
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	170.69	8.18	155.85	7.31
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	166.52	7.98	173.65	8.14
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	165.82	7.95	184.35	8.64
ABEV3	Bebidas	162.16	7.77	170.52	8.00
BBDC4	Intermediários Financeiros	153.35	7.35	157.82	7.40
BPAC11	Intermediários Financeiros	134.27	6.43	136.73	6.41
LREN3	Comércio	123.84	5.93	131.04	6.14
IGTA3	Exploração de Imóveis	121.35	5.81	129.75	6.08

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

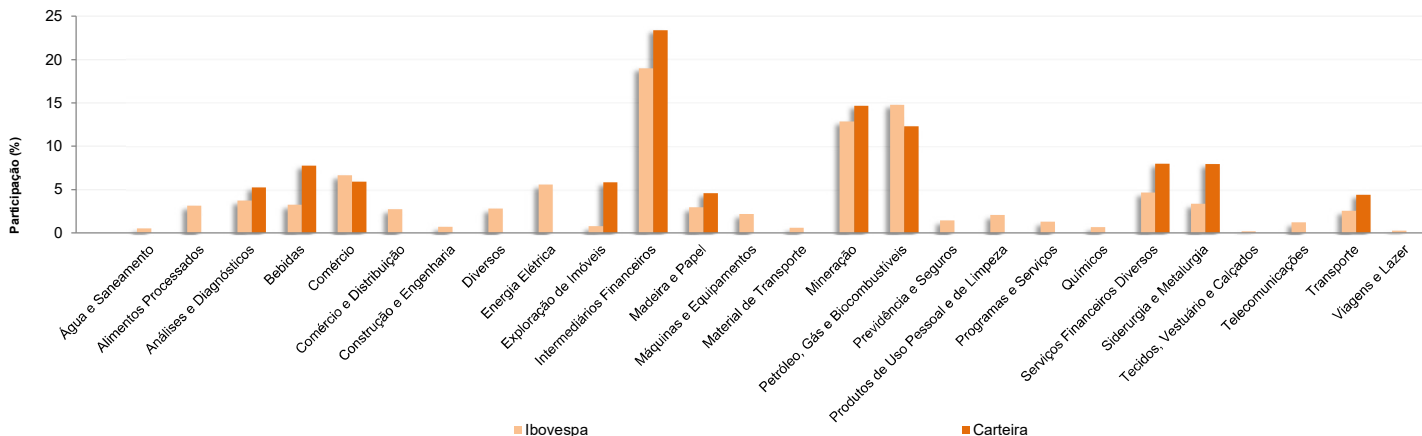
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	305.77	14.65	0.00	1
ITUB4	199.66	9.57	0.00	1
PETRA4	170.69	8.18	0.00	1
B3SA3	166.52	7.98	0.00	1
GGBR4	165.82	7.95	0.00	1
ABEV3	162.16	7.77	0.00	1
BBDC4	153.35	7.35	0.00	1
BPAC11	134.27	6.43	0.00	1
LREN3	123.84	5.93	0.00	1
IGTA3	121.35	5.81	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

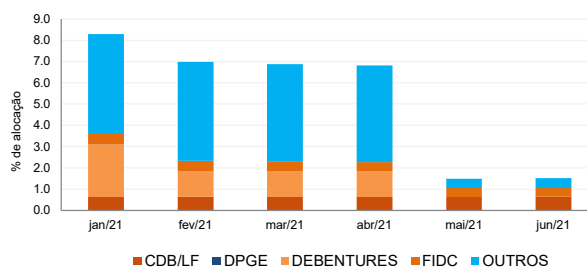
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	1,668.87	0.70	Faixa 2
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,105.51	0.46	Sem Faixa
VALE SA	305.77	0.13	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	199.66	0.08	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	170.69	0.07	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	166.52	0.07	Sem Faixa
GERDAU SA	165.82	0.07	Faixa 1
AMBEV S.A	162.16	0.07	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	134.27	0.06	Faixa 2
LOJAS RENNEN SA	123.84	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: 30/06/2021

## 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	876,694	0.37%	Selic	30-jun-21	0.13%	0.12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3,066,708	1.28%	Selic	01-jun-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	192,765	0.08%	Selic	02-jun-21	0.11%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1,750,061	0.73%	Selic	02-jun-21	0.13%	0.13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1,166,678	0.49%	Selic	02-jun-21	0.13%	0.13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	583,383	0.24%	Selic	02-jun-21	0.13%	0.13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	873,989	0.37%	Selic	02-jun-21	0.16%	0.15%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

