

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 31/08/2021

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	250,013,474.63	97.16%				0.35%	-9.15%	4.36%	4.07%	5.61%	13.85%	25.68%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.87%	7.55%	9.56%	16.14%	25.77%	36.58%
Renda Fixa	250,013,474.63	97.16%			0.02%							
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,398,236.16	8.70%	BB	3.55%	0.02%	0.42%	1.10%	1.69%	1.92%	2.40%	6.08%	12.49%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	60,280,844.71	23.43%	BRADESCO	100%	0.07%	0.13%	0.55%	1.19%	1.16%	1.74%	5.86%	12.75%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	166,338,331.02	64.64%	BRADESCO	1.77%	0.02%	0.42%	1.11%	1.72%	1.96%	2.37%	6.12%	12.59%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	63,880.11	0.02%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.73%	1.99%	3.58%	4.41%	6.28%	14.27%	25.64%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	9,419.70	0.00%	BRPP	3.01%		0.73%	1.99%	3.58%	4.41%	6.28%	14.27%	25.64%
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENI-SEN	922,762.93	0.36%	VILA RICA	1.88%		0.73%	1.99%	3.58%	4.41%	6.28%	14.27%	25.64%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.87%	7.55%	9.56%	16.14%	25.77%	36.58%
Imobiliário	6,799,259.90	2.64%				-0.83%	1.74%	-0.43%	-1.09%	0.78%	8.39%	24.30%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.87%	7.55%	9.56%	16.14%	25.77%	36.58%
Imóveis	4,758,803.40	1.85%				-0.06%	-0.17%	-0.33%	-0.44%	-10.14%		
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1,110,719.31	0.43%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	1,110,719.31	0.43%		100%	3.47%	-0.72%	2.93%	-3.16%	-71.38%	-69.78%	-	-
Benchmark:	CDI					0.42%	1.09%	1.77%	2.06%	2.70%	6.68%	13.38%
FII	929,737.19	0.36%										
VECTOR LAJES FII	929,737.19	0.36%	QUELUZ	12.20%		-0.93%	-1.53%	-7.58%	-9.37%	-5.94%	-33.49%	-30.51%
Benchmark:	IFIX					-2.63%	-2.37%	-4.74%	-4.19%	-1.16%	3.51%	28.53%
Operações com Participantes	211,618.06	0.08%				-2.25%	-41.46%	-44.59%	-46.71%	-46.51%	-51.52%	28.03%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.33%	3.87%	7.55%	9.56%	16.14%	25.77%	36.58%
Total	257,332,381.85	100%			0.05%	0.31%	-8.96%	3.45%	1.22%	5.34%	11.85%	29.04%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.24%	3.61%	7.02%	8.86%	15.04%	23.40%	32.74%

* 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.

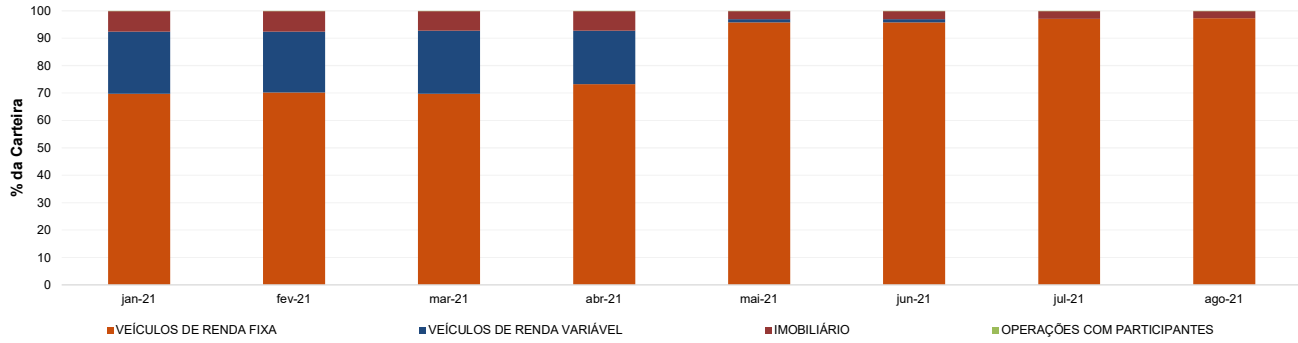
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

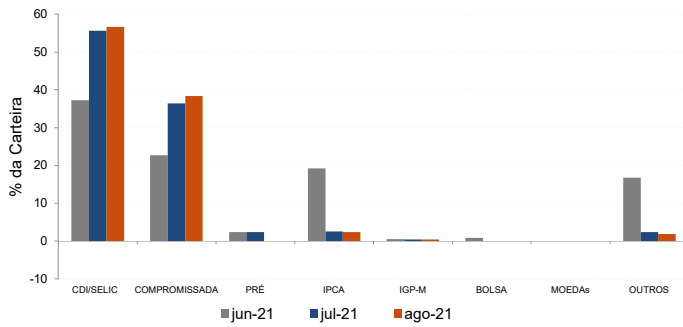
Distribuição da Carteira

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.

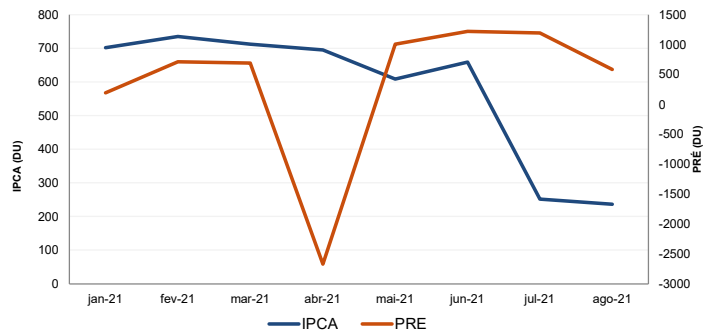
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

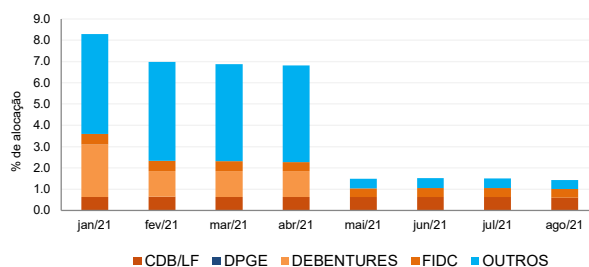
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	1,533.30	0.61	Faixa 1
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,082.54	0.43	Sem Faixa

* 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: 31/08/2021

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	1,747,890	0.69%	Selic	18-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1,747,890	0.69%	Selic	18-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1,726,527	0.68%	Selic	17-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1,186,041	0.47%	Selic	17-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	941,919	0.37%	Selic	11-ago-21	0.09%	0.09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	873,945	0.35%	Selic	18-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	26,024	0.01%	Selic	18-ago-21	0.10%	0.10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2,174,694	0.86%	Selic	27-ago-21	5.00%	0.05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	3,883	0.00%	Selic	17-ago-21	6.00%	0.06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

