

## FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/09/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>249,912,918.75</b>	<b>97.36%</b>				<b>0.08%</b>	<b>-9.22%</b>	<b>4.29%</b>	<b>4.15%</b>	<b>5.80%</b>	<b>11.86%</b>	<b>25.32%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.63%	4.49%	7.87%	11.34%	16.52%	27.35%	37.86%
<b>Renda Fixa</b>	<b>249,912,918.75</b>	<b>97.36%</b>			<b>0.03%</b>							
BB INSTITUCIONAL FEDERAL FICFI RF LP	22,498,312.40	8.77%	BB	3.53%	0.02%	0.45%	1.25%	1.97%	2.38%	2.90%	6.08%	12.49%
BRADESCO FI MULT FIOPREV	60,563,612.20	23.59%	BRADESCO	100%	0.12%	0.47%	0.75%	1.57%	1.64%	2.12%	5.82%	12.78%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	166,781,118.97	64.98%	BRADESCO	1.82%	0.02%	0.45%	1.25%	1.98%	2.41%	2.85%	6.11%	12.58%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	62,163.65	0.02%	BRASIL PLURAL	3.33%		0.73%	2.13%	3.80%	5.17%	6.58%	14.23%	25.64%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	7,711.54	0.00%	BRPP	3.01%		0.73%	2.13%	3.80%	5.17%	6.58%	14.23%	25.64%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.63%	4.49%	7.87%	11.34%	16.52%	27.35%	37.86%
<b>Imobiliário</b>	<b>6,565,188.73</b>	<b>2.56%</b>				<b>-0.22%</b>	<b>0.65%</b>	<b>-1.02%</b>	<b>-1.31%</b>	<b>0.46%</b>	<b>6.74%</b>	<b>23.76%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.63%	4.49%	7.87%	11.34%	16.52%	27.35%	37.86%
<b>Imóveis</b>	<b>4,756,153.83</b>	<b>1.85%</b>				<b>-0.06%</b>	<b>-0.17%</b>	<b>-0.33%</b>	<b>-0.50%</b>	<b>-10.53%</b>		
<b>CARTEIRA PRÓPRIA IM</b>	<b>1,088,713.31</b>	<b>0.42%</b>										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARIZ	1,088,713.31	0.42%		100%	2.34%	-1.98%	-3.06%	-5.50%	-71.94%	-70.37%	-	-
Benchmark:	CDI					0.44%	1.22%	2.01%	2.51%	2.99%	6.65%	13.35%
<b>FII</b>	<b>720,321.59</b>	<b>0.28%</b>										
VECTOR LAJES FII	720,321.59	0.28%	QUELUZ	12.20%		-2.86%	-5.89%	-4.04%	-10.55%	-8.85%	-36.22%	-33.06%
Benchmark:	IFIX					-1.24%	-1.42%	-4.61%	-5.38%	-2.83%	1.17%	27.21%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>202,804.30</b>	<b>0.08%</b>				<b>-2.31%</b>	<b>-41.96%</b>	<b>-45.32%</b>	<b>-47.94%</b>	<b>-45.92%</b>	<b>-52.95%</b>	<b>12.54%</b>
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					1.63%	4.49%	7.87%	11.34%	16.52%	27.35%	37.86%
<b>Total</b>	<b>256,680,911.79</b>	<b>100%</b>			<b>0.05%</b>	<b>0.07%</b>	<b>-9.03%</b>	<b>2.30%</b>	<b>1.29%</b>	<b>6.56%</b>	<b>9.85%</b>	<b>28.03%</b>
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					1.55%	4.23%	7.35%	10.55%	15.42%	24.94%	33.97%

\* 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.

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

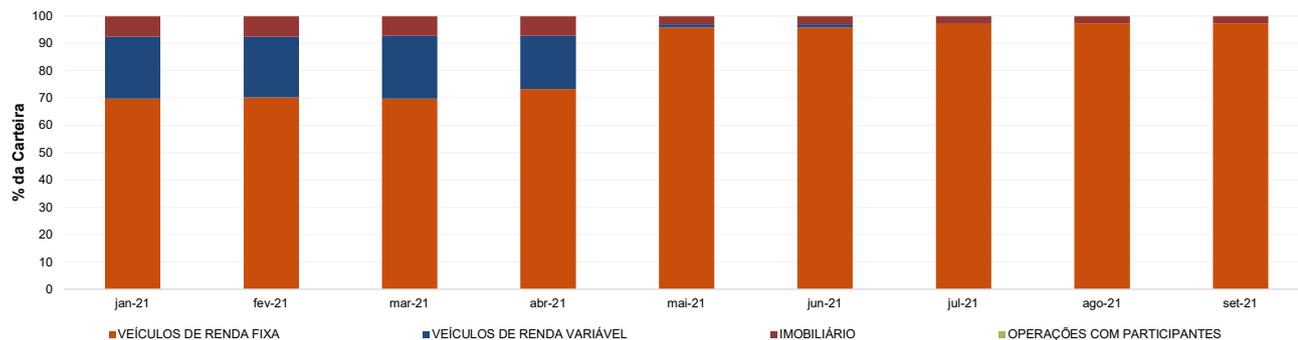
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

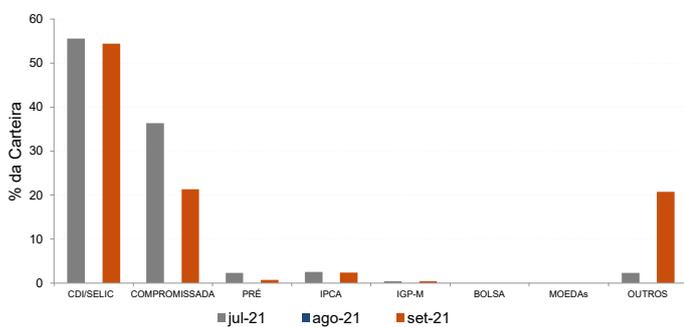
## Distribuição da Carteira

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.

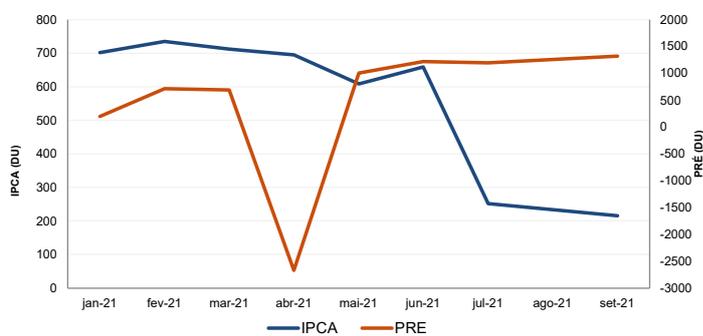
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/09/2021

## Análises de Contrapartes

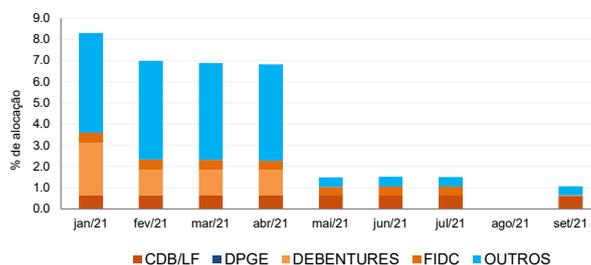
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	1,542.88	0.61	Faixa 1
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1,071.33	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: 30/09/2021

## 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 2022-03-01	01-mar-22	1,245,407	0.49%	Selic	21-set-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	988,418	0.39%	Selic	09-set-21	4.00%	0.04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	790,734	0.31%	Selic	09-set-21	4.00%	0.04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	5,717,202	2.27%	Selic	02-set-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1,581,358	0.63%	Selic	02-set-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	608,230	0.24%	Selic	02-set-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	33,604	0.01%	Selic	09-set-21	0.03%	0.03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	5,927,282	2.35%	Selic	09-set-21	0.08%	0.08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	2,168,579	0.86%	Selic	16-set-21	0.15%	0.16%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1,575,851	0.63%	Selic	01-set-21	0.17%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	2,755,451	1.09%	Selic	21-set-21	0.16%	0.00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	2,157,545	0.86%	Selic	28-set-21	0.21%	0.21%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

