

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/06/2022

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	36.344.341,15	86,04%				1,29%	3,04%	5,35%	5,35%	7,95%	11,79%	20,37%
Benchmark:	CDI					1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%
Renda Fixa	36.344.341,15	86,04%										
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	36.237.475,50	85,79%	BRADESCO	0,46%	0,09%	1,00%	2,75%	5,23%	5,23%	8,48%	10,53%	15,40%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	0,00	0,00%	BRASIL PLURAL	0,65%		1,30%	3,78%	7,20%	7,20%	12,46%	19,02%	28,89%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	106.865,64	0,25%	GENIAL	5,22%		1,30%	3,78%	7,20%	7,20%	12,46%	19,02%	28,89%
Benchmark:	CDI					1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%
Imobiliário **	5.801.825,43	13,73%				0,33%	0,57%	1,10%	1,10%	1,90%	3,91%	10,33%
Benchmark:	CDI + 1% a.a.					1,10%	3,16%	5,92%	5,92%	9,74%	13,35%	19,78%
Imóveis	4.735.672,60	11,21%				-0,06%	-0,11%	-0,26%	-0,26%	-0,60%	-9,90%	
CARTEIRA PRÓPRIA IM	1.066.152,83	2,52%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR	1.066.152,83	2,52%		100%		2,03%	3,51%	7,25%	7,25%	7,91%	13,49%	-
Benchmark:	CDI					1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%
Operações com Participantes **	123.425,40	0,29%				-2,77%	-7,57%	-14,15%	-14,15%	-13,30%	-20,58%	-25,86%
Benchmark:	CDI					1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%
Total	42.241.751,09	100%			0,07%	1,15%	2,67%	4,79%	4,79%	7,20%	15,31%	20,16%
Benchmark:	INPC + 4.2% a.a.					0,97%	3,16%	7,77%	7,77%	16,62%	32,70%	41,54%

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/05/2022

* 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.

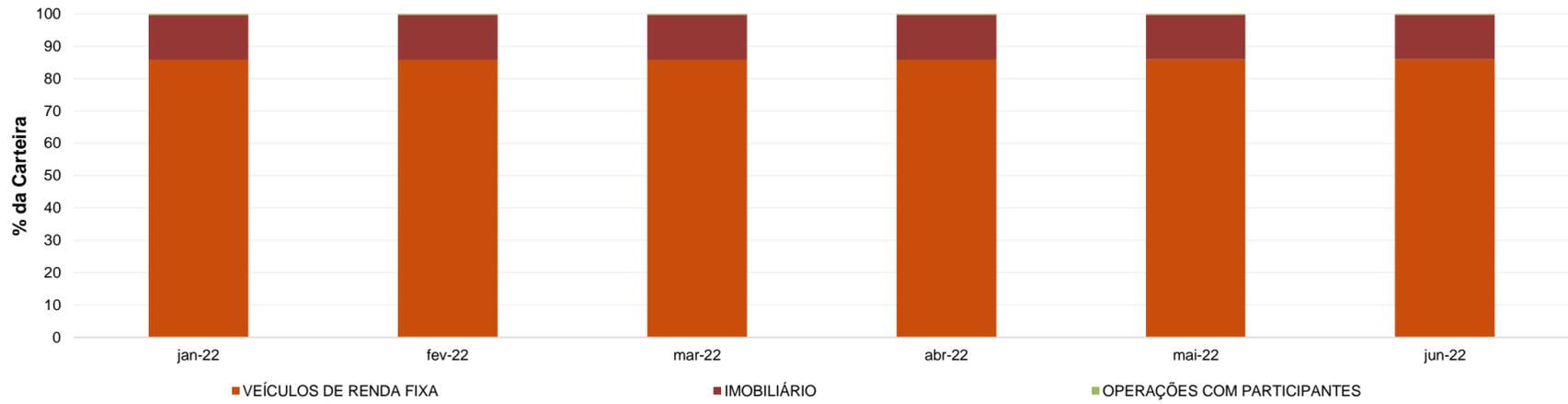
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

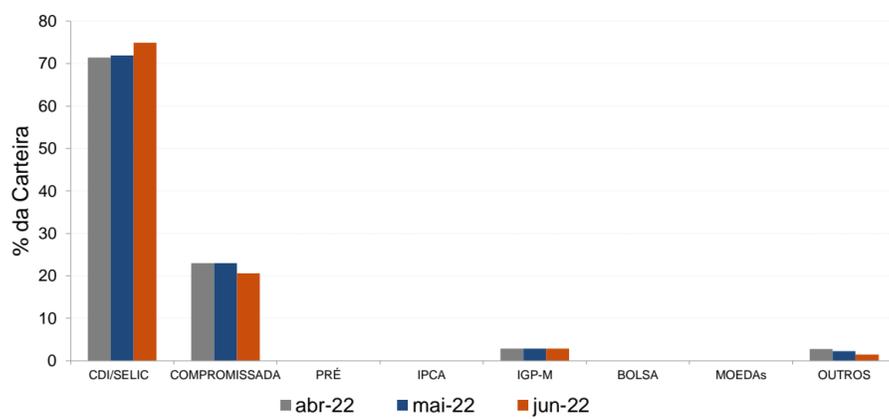
Distribuição da Carteira

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.

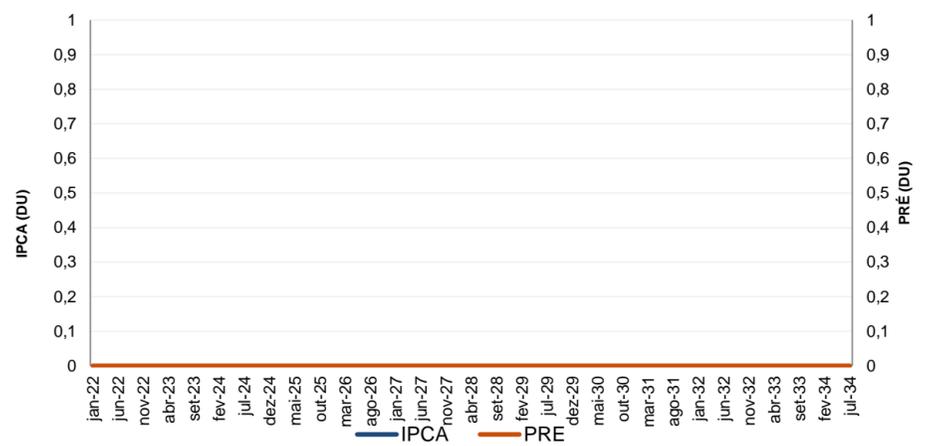
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/06/2022

Análises de Contrapartes

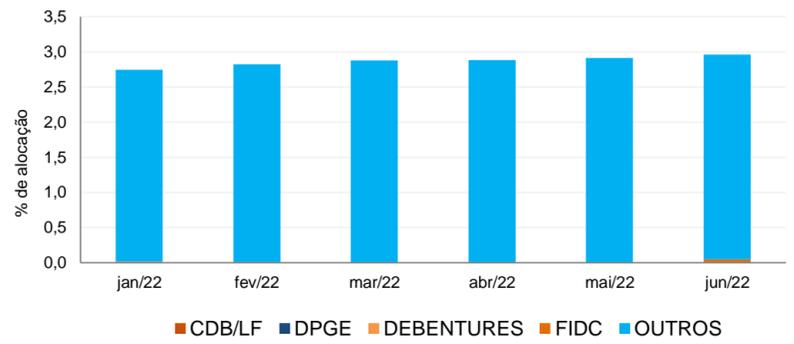
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1.085,26	2,91	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: 30/06/2022

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 2022-09-01	01-set-22	232.622	0,62%	Selic	29-jun-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	137.386	0,37%	Selic	07-jun-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	123.625	0,33%	Selic	09-jun-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	823.880	2,21%	Selic	20-jun-22	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	165	0,00%	Selic	01-jun-22	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	55	0,00%	Selic	22-jun-22	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	164.427	0,44%	Selic	15-jun-22	0,11%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	328.491	0,88%	Selic	15-jun-22	0,13%	0,13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	272.781	0,73%	Selic	15-jun-22	0,17%	0,16%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT



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.