

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base:30/06/2023

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	47.933.599,82	89,36%				0,66%	2,45%	5,93%	5,93%	12,49%	21,44%	25,76%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
Renda Fixa	47.933.599,82	89,36%			0,03%	0,66%	2,49%	5,97%	5,97%	12,40%	19,90%	22,88%
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	47.878.472,24	89,26%	BRADESCO	0,46%	0,03%	1,07%	3,09%	6,38%	6,38%	13,28%	22,89%	25,21%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	16.295,07	0,03%	BRASIL PLURAL	0,00%		1,36%	4,01%	8,32%	8,32%	17,50%	32,14%	39,85%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	38.832,51	0,07%	GENIAL	0,00%		1,36%	4,01%	8,32%	8,32%	17,50%	32,14%	39,85%
Benchmark:	INPC + 5,2% a.a.					0,32%	2,04%	5,28%	5,28%	8,33%	27,55%	46,53%
Imobiliário **	5.625.327,56	10,49%				0,03%	0,62%	1,00%	1,00%	0,76%	2,67%	4,69%
Benchmark:	CDI + 1% a.a.					1,16%	3,39%	7,02%	7,02%	14,67%	25,84%	29,98%
Imóveis	4.703.162,34	8,77%				-0,05%	-0,16%	-0,34%	-0,34%	-0,68%	-1,33%	-10,57%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	922.165,22	1,72%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIARI/	922.165,22	1,72%		100%	4,14%	0,42%	4,66%	8,18%	8,18%	8,28%	17,24%	23,31%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
Operações com Participantes **	56.811,67	0,11%				16,64%	-5,12%	-17,97%	-17,97%	-7,41%	-19,23%	-26,01%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
Total	53.639.754,25	100%			0,08%	0,61%	2,24%	5,35%	5,35%	11,08%	19,02%	28,02%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/05/2023

* 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 informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

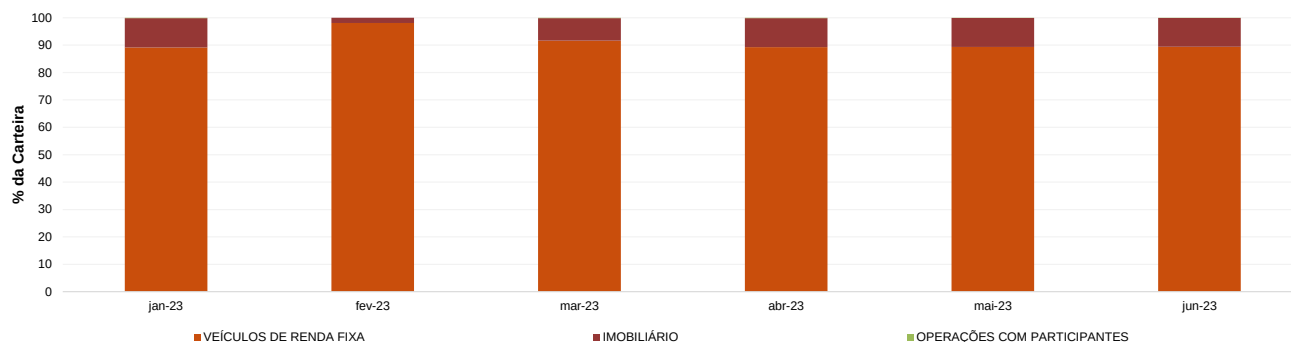
FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 30/06/2023

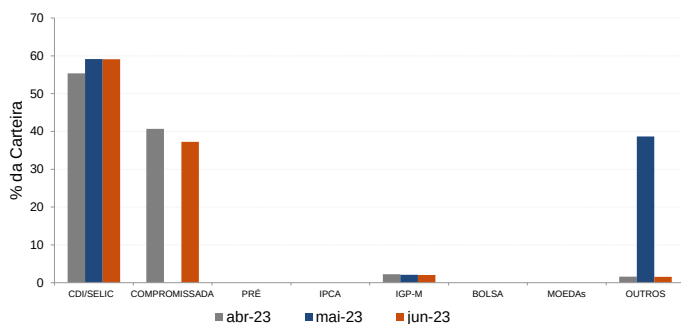
Distribuição da Carteira

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.

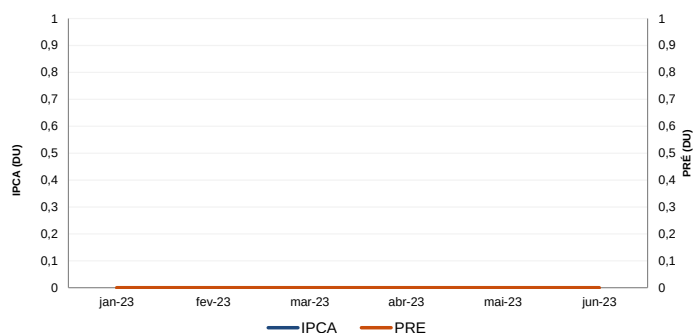
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

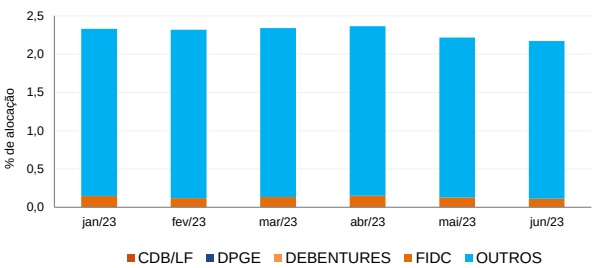
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BRAZILIAN SECURITIES CIA SECURITIZACAO	1.007,87	2,06	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: 30/06/2023

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 2024-03-01	01-mar-24	612.552	1,25%	Selic	28-jun-23	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF. DI FEDERAL EX1
LFT 2024-09-01	01-set-24	153.138	0,31%	Selic	22-jun-23	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF. DI FEDERAL EX1
LFT 2025-03-01	01-mar-25	765.622	1,56%	Selic	29-jun-23	0,01%	0,01%	BRABESCO FI RF REF. DI FEDERAL EX1