

FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/12/2023

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	49.374.755,69	89,66%				0,92%	2,33%	6,04%	12,33%	12,33%	25,67%	29,89%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
Renda Fixa	49.374.755,69	89,66%			0,01%							
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	49.301.936,86	89,53%	BRADESCO	0,46%	0,01%	0,88%	2,74%	5,98%	12,74%	12,74%	26,34%	31,75%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER II-SEM	34.713,78	0,06%	GENIAL	0,00%		1,17%	3,70%	7,98%	16,96%	16,96%	36,01%	46,94%
FIDC MULTISSETORIAL MASTER-SEM	38.105,05	0,07%	PLURAL	0,00%		1,17%	3,70%	7,98%	16,96%	16,96%	36,01%	46,94%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,96%	2,02%	3,56%	9,03%	9,03%	21,48%	40,76%
Imobiliário	5.566.721,50	10,11%				0,21%	1,27%	0,62%	1,63%	1,63%	2,49%	1,29%
Benchmark:	CDI + 1% a.a.					0,98%	3,09%	6,67%	14,16%	14,16%	29,57%	36,61%
Imóveis	4.659.680,59	8,46%				-0,11%	-0,34%	-0,87%	-1,21%	-1,21%	-1,86%	-2,51%
CARTEIRA PRÓPRIA IM	907.040,91	1,65%										
FIOPREV PLANO BD CARTEIRA PROPRIA IMOBILIAR	907.040,91	1,65%		100%	1,60%	0,94%	2,46%	6,08%	12,42%	12,42%	25,72%	26,97%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
Operações com Participantes	104.421,12	0,19%				-6,01%	841,66%	160,54%	113,72%	113,72%	108,37%	88,74%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
Total	55.069.913,51	100%			0,03%	0,84%	2,40%	5,59%	11,24%	11,24%	22,84%	26,63%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%

* 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.

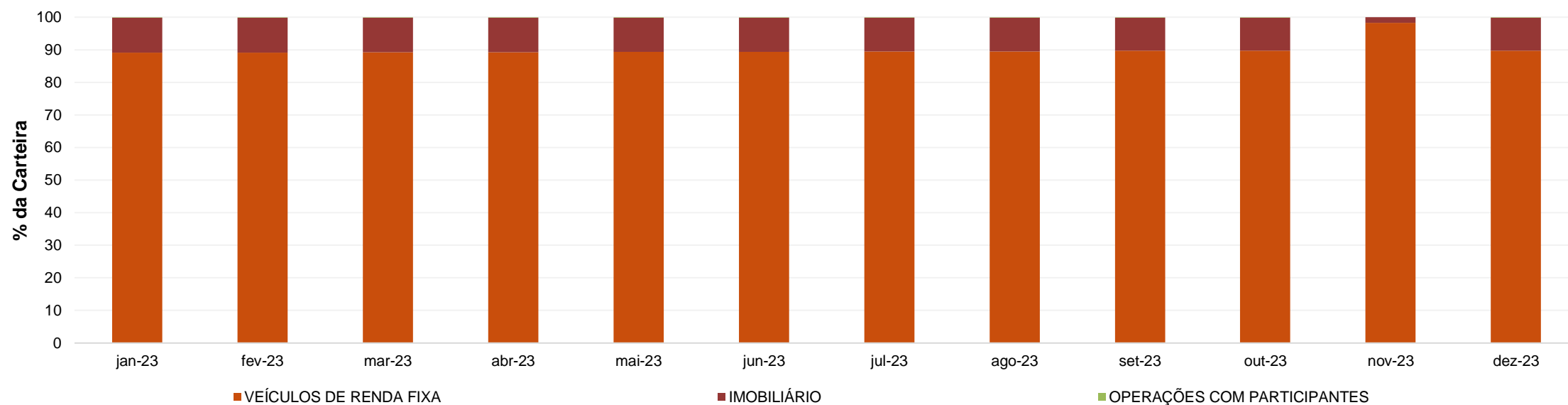
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

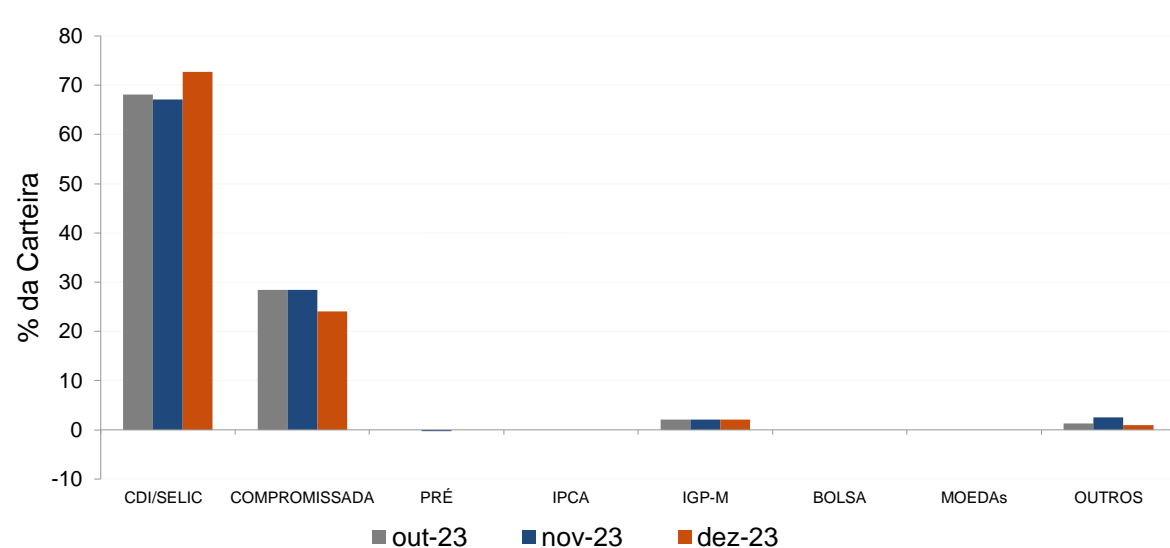
Distribuição da Carteira

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.

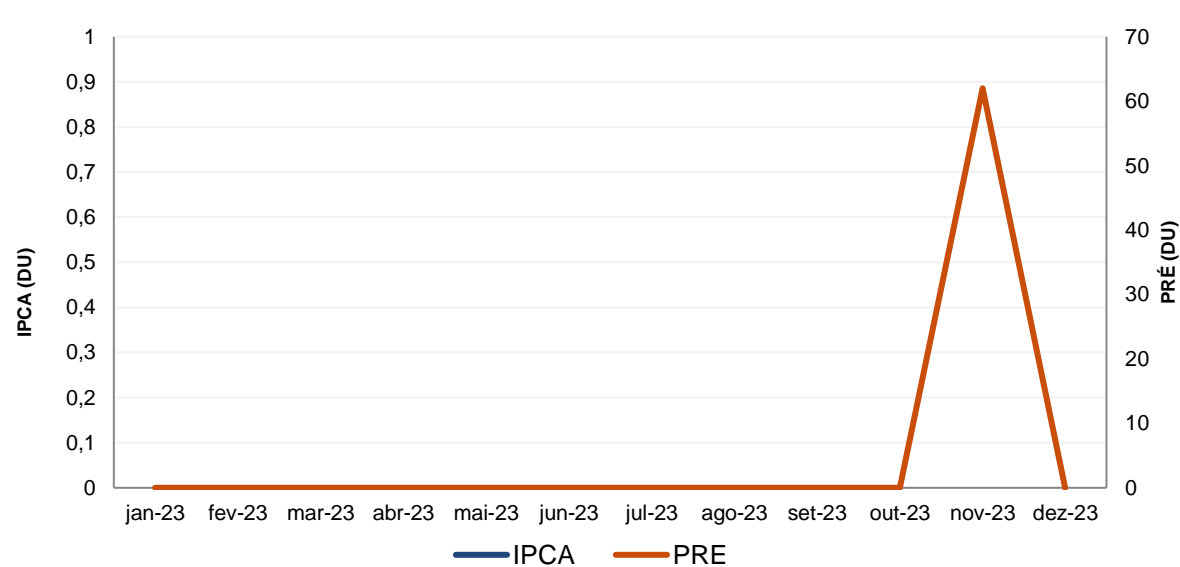
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



FIOPREV - FIOPREV PLANO BD

Data-base: 29/12/2023

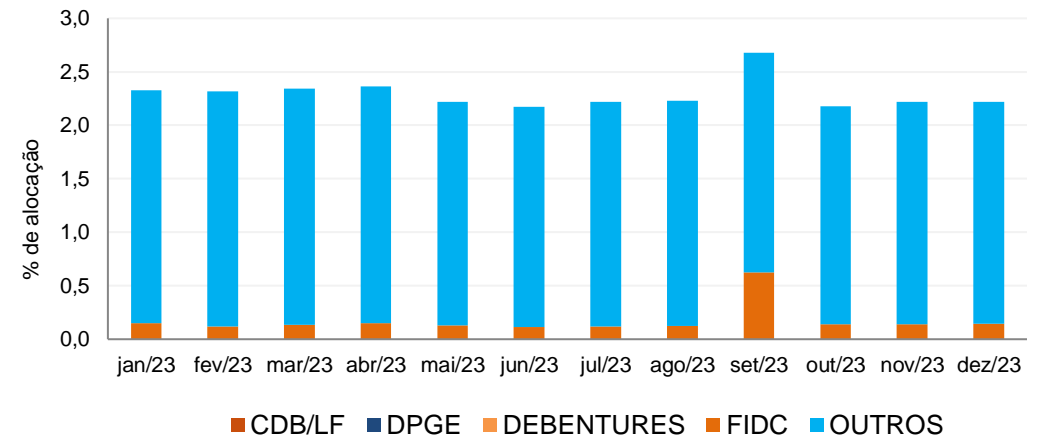
Análises de Contrapartes

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	1.046,09	2,07	Sem Faixa

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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.								

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	223.044	0,44%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	98.402	0,20%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	984.022	1,95%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	229.605	0,46%	Selic	13-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	168.924	0,33%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	98.402	0,20%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	52.478	0,10%	Selic	19-dez-23	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2028-03-01	01-mar-28	652.845	1,29%	Selic	14-dez-23	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT