

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2020

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>711.862,54</b>	<b>100%</b>				<b>0,18%</b>	<b>0,71%</b>	<b>1,73%</b>	<b>1,09%</b>	<b>4,49%</b>	<b>10,27%</b>	<b>18,91%</b>
Benchmark:	CDI					0,28%	0,92%	2,07%	1,30%	5,20%	11,88%	20,96%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>711.862,54</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>							
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	123.928,24	17,41%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,26%	0,86%	1,96%	1,22%	4,99%	11,45%	20,42%
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	587.934,30	82,60%	VOTORANTIM	0,33%	0,01%	0,16%	0,67%	1,78%	1,06%	4,94%	11,62%	20,89%
Benchmark:	CDI					0,28%	0,92%	2,07%	1,30%	5,20%	11,88%	20,96%
<b>Total</b>	<b>711.803,58</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>	<b>0,18%</b>	<b>0,71%</b>	<b>1,73%</b>	<b>1,09%</b>	<b>4,49%</b>	<b>10,27%</b>	<b>18,91%</b>
Benchmark:	CDI					0,28%	0,92%	2,07%	1,30%	5,20%	11,88%	20,96%

\* 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.

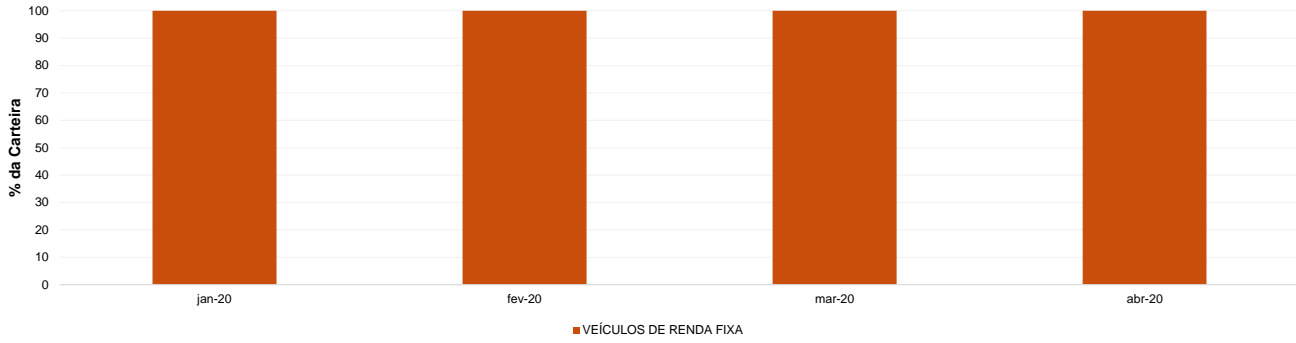
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2020

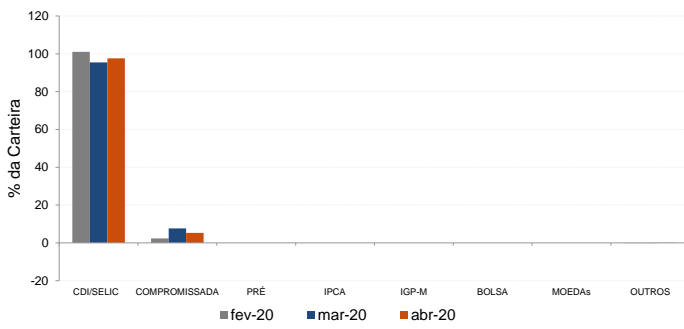
## Distribuição da Carteira

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.

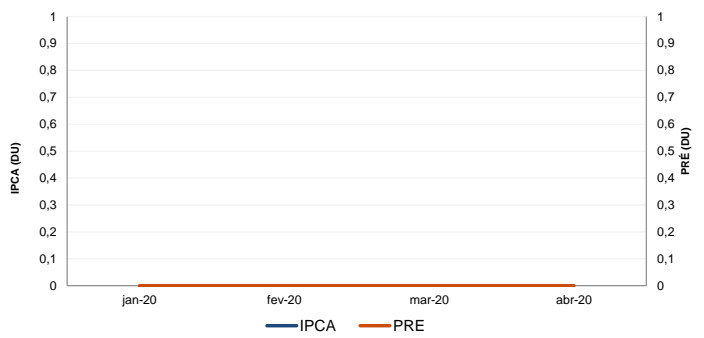
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2020

## Análises de Contrapartes

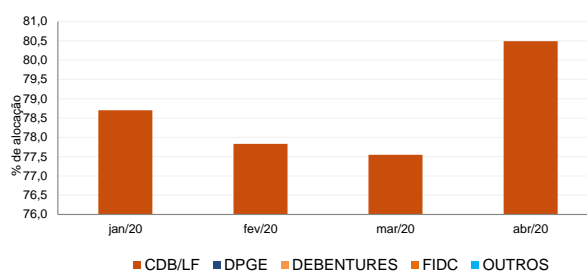
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	82,35	11,60	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	64,89	9,14	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	43,93	6,19	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	41,46	5,84	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	38,89	5,48	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	38,32	5,40	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	35,82	5,04	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	34,27	4,83	Faixa 2
BCO ITAU SA	34,17	4,81	Faixa 2
BCO BRASIL SA	32,28	4,55	Faixa 2

\* 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.								

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2020

## 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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	14-mai-20	22.182	3,12%	CDI	BCO BRASIL SA	23-abr-20	101,92%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	14-mai-20	10.095	1,42%	CDI	BCO BRASIL SA	27-abr-20	101,92%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	07-ago-20	27.263	3,84%	CDI	BCO SAFRA SA	09-abr-20	0,04%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	31-ago-20	3.111	0,44%	CDI	PARANA BCO SA	16-abr-20	0,19%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	31-ago-20	3.110	0,44%	CDI	PARANA BCO SA	16-abr-20	0,19%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	31-ago-20	777	0,11%	CDI	PARANA BCO SA	16-abr-20	0,19%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	05-out-20	14.401	2,03%	CDI	BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA	09-abr-20	0,02%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	21-dez-20	9.593	1,35%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	16-abr-20	0,03%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	24-mai-23	1.624	0,23%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	15-abr-20	110,55%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	18-jul-23	3.605	0,51%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	09-abr-20	110,63%	Faixa 2	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-09-01	01-set-20	140	0,02%	Selic		22-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	4	0,00%	Selic		01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	4	0,00%	Selic		17-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic		24-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic		13-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		20-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		22-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		01-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		24-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		07-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		02-abr-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	8.106	1,14%	Selic		24-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	486	0,07%	Selic		23-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	264	0,04%	Selic		13-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	130	0,02%	Selic		17-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.431	0,34%	Selic		27-abr-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	52	0,01%	Selic		17-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	89	0,01%	Selic		17-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	4.969	0,70%	Selic		23-abr-20	0,03%	0,03%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2025-09-01	01-set-25	9.585	1,35%	Selic		13-abr-20	0,03%	0,03%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.295	0,18%	Selic		03-abr-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT