

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2020

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 |
| Renda Fixa | 703.285,99 | 100% | | | | 0,16% | 0,44% | 1,10% | 1,78% | 3,28% | 8,99% | 15,87% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,16% | 0,57% | 1,44% | 2,12% | 3,88% | 10,40% | 17,95% |
| Renda Fixa CDI | 703.285,99 | 100% | | | 0,01% | | | | | | | |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 111.357,37 | 15,84% | BRADESCO | 0,00% | 0,01% | 0,15% | 0,52% | 1,34% | 1,98% | 3,66% | 9,99% | 17,31% |
| BV BANKS RF CRED PRIV FI | 591.928,62 | 84,17% | VOTORANTIM | 0,34% | 0,01% | 0,17% | 0,43% | 1,05% | 1,75% | 3,45% | 9,99% | 17,58% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,16% | 0,57% | 1,44% | 2,12% | 3,88% | 10,40% | 17,95% |
| Total | 703.223,24 | 100% | | | 0,01% | 0,16% | 0,45% | 1,10% | 1,78% | 3,28% | 8,99% | 15,88% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,16% | 0,57% | 1,44% | 2,12% | 3,88% | 10,40% | 17,95% |

* 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.

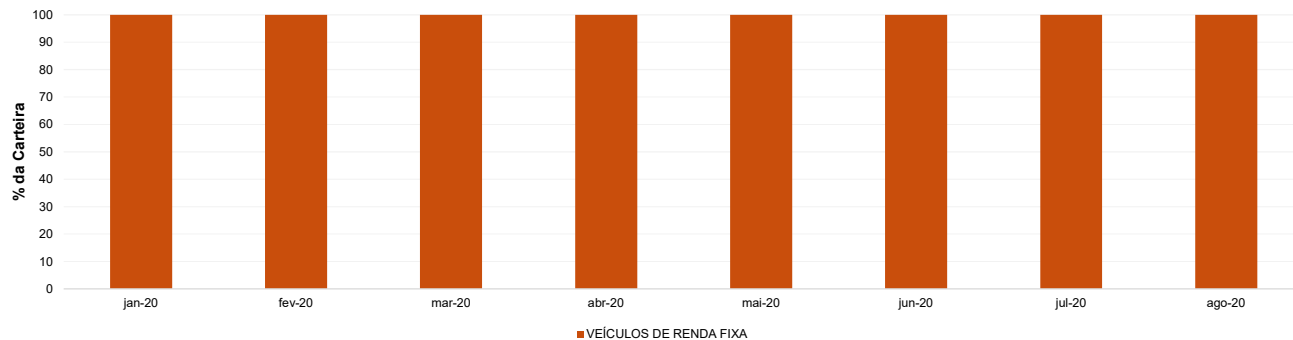
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

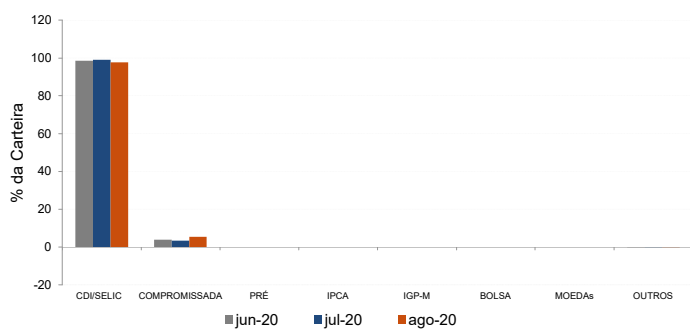
Distribuição da Carteira

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.

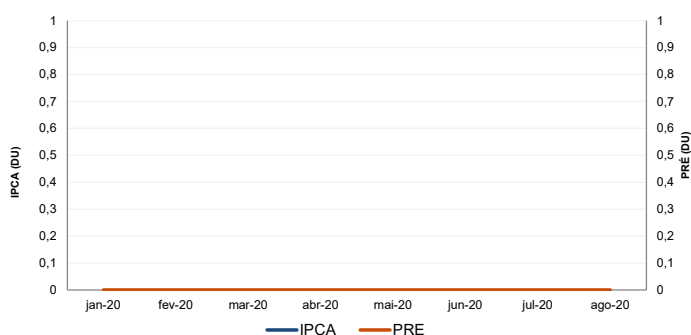
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2020

Análises de Contrapartes

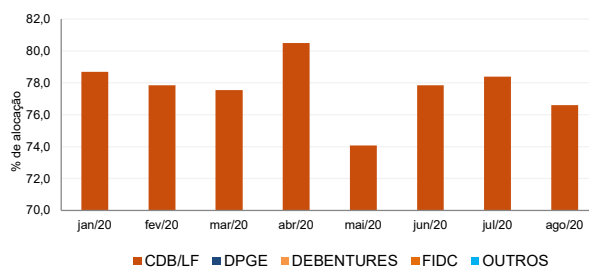
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--|-------|------|---------------------------|
| BCO VOTORANTIM SA | 69,40 | 9,85 | Faixa 2 |
| BCO SAFRA SA | 61,41 | 8,72 | Faixa 2 |
| BCO BTG PACTUAL SA | 59,87 | 8,50 | Faixa 2 |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 42,41 | 6,02 | Faixa 1 |
| BCO CNH CAPITAL SA | 39,77 | 5,65 | Faixa 1 |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | 39,19 | 5,56 | Faixa 1 |
| BANCO RCI BRASIL SA | 36,63 | 5,20 | Faixa 2 |
| BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA) | 35,05 | 4,98 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 34,94 | 4,96 | Faixa 2 |
| BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI | 29,57 | 4,20 | 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: 31/08/2020

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 | 21-dez-20 | 2.724 | 0,39% | CDI | BCO BTG PACTUAL SA | 10-ago-20 | 0,01% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |
| LF CDI | 01-mar-21 | 9.331 | 1,32% | CDI | BCO BTG PACTUAL SA | 24-ago-20 | 0,01% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |
| LF CDI | 28-mar-22 | 2.864 | 0,41% | CDI | BCO BTG PACTUAL SA | 10-ago-20 | 0,13% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |
| LF CDI | 24-mai-23 | 3.636 | 0,52% | CDI | BCO VOTORANTIM SA | 18-ago-20 | 139,75% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |
| LF CDI | 18-jul-23 | 4.008 | 0,57% | CDI | BCO VOTORANTIM SA | 18-ago-20 | 139,90% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |
| LF CDI | 18-jul-23 | 4.005 | 0,57% | CDI | BCO VOTORANTIM SA | 24-ago-20 | 139,89% | Faixa 2 | BV BANKS RF CRED PRIV FI |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|-------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|-----------------------------------|
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 90 | 0,01% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 32 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 25 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 20 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 14 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 11 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 9 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 7 | 0,00% | Selic | | 03-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 6 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 6 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 5 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 5 | 0,00% | Selic | | 03-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 4 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 4 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 4 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 3 | 0,00% | Selic | | 07-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 3 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 3 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 3 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 2 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 2 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 2 | 0,00% | Selic | | 13-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 2 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 2 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 10-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 03-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 14-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 17-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 06-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 12-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 14-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 06-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 11-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 13-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 1 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 03-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 04-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 04-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-09-01 | 01-set-20 | 0 | 0,00% | Selic | | 18-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1.103 | 0,16% | Selic | | 03-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 851 | 0,12% | Selic | | 27-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 425 | 0,06% | Selic | | 28-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 307 | 0,04% | Selic | | 25-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 173 | 0,02% | Selic | | 17-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 158 | 0,02% | Selic | | 06-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 158 | 0,02% | Selic | | 17-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 3 | 0,00% | Selic | | 25-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 2 | 0,00% | Selic | | 25-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1 | 0,00% | Selic | | 20-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1 | 0,00% | Selic | | 19-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1 | 0,00% | Selic | | 28-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1 | 0,00% | Selic | | 28-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1 | 0,00% | Selic | | 27-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 0 | 0,00% | Selic | | 25-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 0 | 0,00% | Selic | | 28-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 0 | 0,00% | Selic | | 31-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 0 | 0,00% | Selic | | 20-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 3.150 | 0,45% | Selic | | 14-ago-20 | 0,02% | 0,02% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |