

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 28/02/2020

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	710.753,07	100%			0,30%	0,99%	2,16%	0,68%	4,96%	10,82%	20,60%	
Benchmark:	CDI				0,29%	1,05%	2,40%	0,67%	5,58%	12,35%	22,43%	
Renda Fixa CDI	710.753,07	100%		0,01%								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	124.994,37	17,60%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,27%	0,99%	2,29%	0,63%	5,38%	11,93%	21,91%
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	585.758,70	82,46%	VOTORANTIM	0,35%	0,01%	0,30%	1,02%	2,37%	0,69%	5,59%	12,37%	22,71%
Benchmark:	CDI				0,29%	1,05%	2,40%	0,67%	5,58%	12,35%	22,43%	
Total	710.319,59	100%		0,01%	0,30%	0,99%	2,16%	0,68%	4,96%	10,82%	20,60%	
Benchmark:	CDI				0,29%	1,05%	2,40%	0,67%	5,58%	12,35%	22,43%	

* 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.

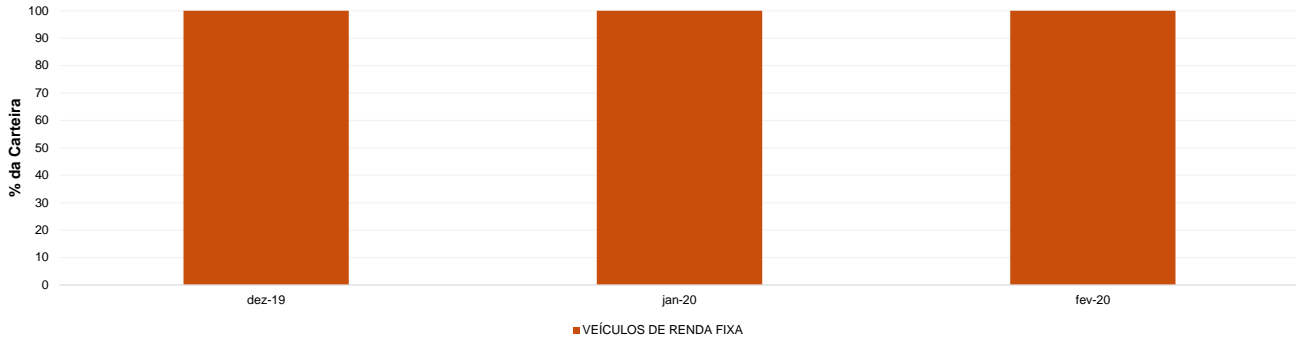
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 28/02/2020

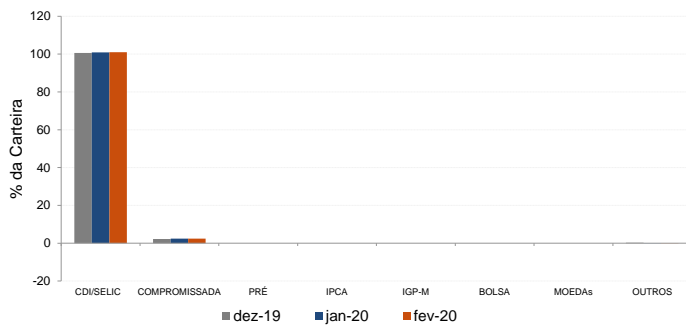
Distribuição da Carteira

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.

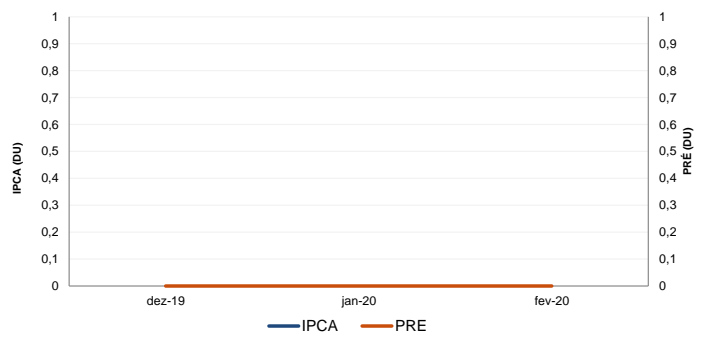
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

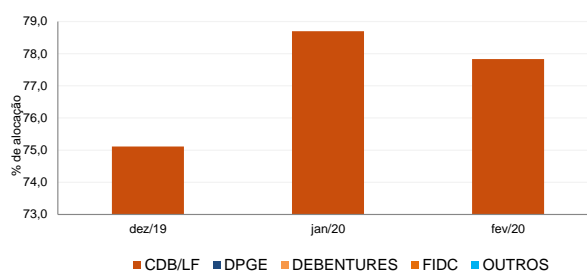
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO VOTORANTIM SA	82,37	11,62	Faixa 2
BCO SAFRA SA	57,73	8,14	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	43,45	6,13	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	40,77	5,75	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	40,16	5,66	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	37,54	5,30	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	35,97	5,07	Faixa 2
BCO ITAU SA	35,81	5,05	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	34,71	4,89	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	30,30	4,27	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: 28/02/2020

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-03-01	01-mar-20	36	0,01%	Selic	12-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	19	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	17	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	7	0,00%	Selic	12-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	7	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	6	0,00%	Selic	07-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	6	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	6	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	6	0,00%	Selic	12-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	5	0,00%	Selic	12-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	5	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	4	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3	0,00%	Selic	21-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	13-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	04-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	13-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	18-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	10-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	17-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	10-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	12-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	10-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	19-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	19-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	10-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	03-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	04-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	06-fev-20	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	11-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	17-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	20-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	11-fev-20	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	26-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	26-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	27-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	21-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	26-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	269	0,04%	Selic	05-fev-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	24.842	3,50%	Selic	11-fev-20	0,01%	0,02%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV