

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2020

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 | 709.469,74 | 100% | | | 0,38% | 1,02% | 2,30% | 0,38% | 5,11% | 10,98% | 21,28% | |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,38% | 1,14% | 2,61% | 0,38% | 5,79% | 12,54% | 23,13% | |
| RF CRÉDITO | 583.998,42 | 82,37% | | | | | | | | | | |
| VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV | 583.998,42 | 82,37% | VOTORANTIM | 0,33% | 0,00% | 0,39% | 1,10% | 2,58% | 0,39% | 5,80% | 12,54% | 23,41% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,38% | 1,14% | 2,61% | 0,38% | 5,79% | 12,54% | 23,13% |
| RF REFERENCIADO DI | 125.471,32 | 17,70% | | | | | | | | | | |
| BRADERSCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 125.471,32 | 17,70% | BRADERSCO | 0,00% | 0,00% | 0,36% | 1,09% | 2,52% | 0,36% | 5,60% | 12,13% | 22,62% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,38% | 1,14% | 2,61% | 0,38% | 5,79% | 12,54% | 23,13% |
| Total | 709.024,62 | 100% | | | 0,00% | 0,38% | 1,02% | 2,30% | 0,38% | 5,11% | 10,98% | 21,28% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,38% | 1,14% | 2,61% | 0,38% | 5,79% | 12,54% | 23,13% |

* 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.

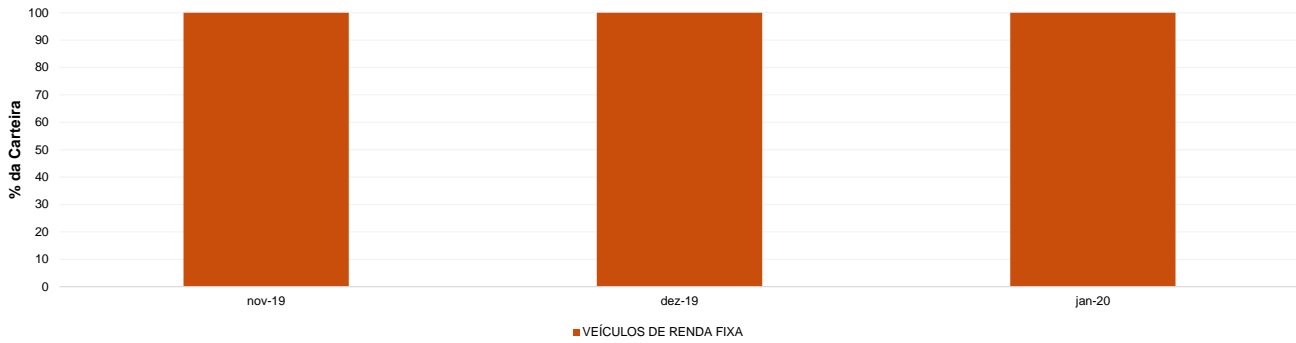
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2020

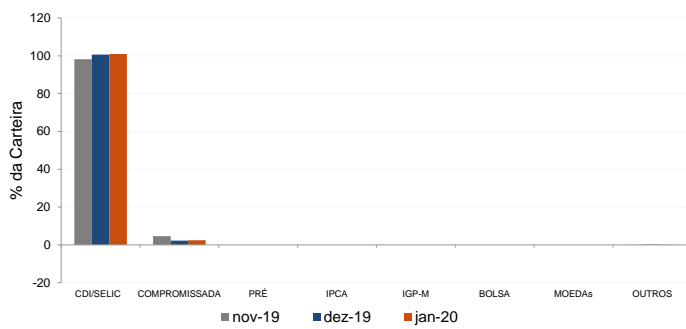
Distribuição da Carteira

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.

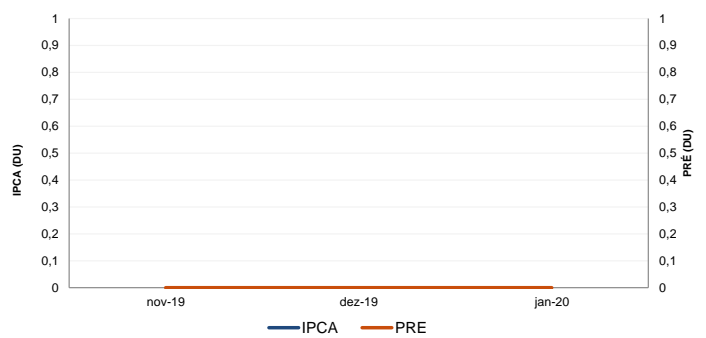
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2020

Análises de Contrapartes

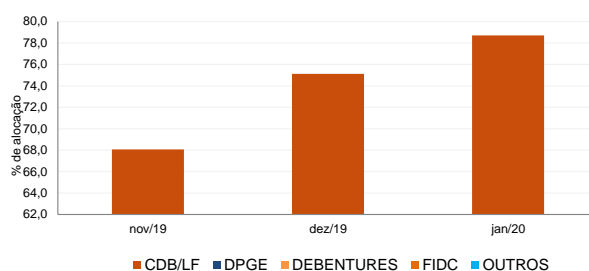
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--|-------|-------|---------------------------|
| BCO VOTORANTIM SA | 78,18 | 11,05 | Faixa 2 |
| BCO SAFRA SA | 64,98 | 9,18 | Faixa 2 |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 41,27 | 5,83 | Faixa 1 |
| BCO CNH CAPITAL SA | 38,72 | 5,47 | Faixa 1 |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | 38,15 | 5,39 | Faixa 1 |
| BANCO RCI BRASIL SA | 35,66 | 5,04 | Faixa 1 |
| BCO BTG PACTUAL SA | 34,16 | 4,83 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 34,01 | 4,81 | Faixa 2 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA) | 32,97 | 4,66 | Faixa 2 |
| BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI | 28,78 | 4,07 | 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: 31/01/2020

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 | 1 | 0,00% | Selic | 23-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 1 | 0,00% | Selic | 29-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 1 | 0,00% | Selic | 30-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 1 | 0,00% | Selic | 28-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 0 | 0,00% | Selic | 29-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 0 | 0,00% | Selic | 27-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 0 | 0,00% | Selic | 30-jan-20 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 2.053 | 0,29% | Selic | 15-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1.659 | 0,23% | Selic | 27-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 581 | 0,08% | Selic | 29-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 548 | 0,08% | Selic | 28-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 498 | 0,07% | Selic | 28-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 91 | 0,01% | Selic | 30-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 1.245 | 0,18% | Selic | 28-jan-20 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 3.349 | 0,47% | Selic | 06-jan-20 | 0,01% | 0,01% | VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRV |