

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/07/2020

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	702.208,15	100%				0,22%	0,52%	1,23%	1,62%	3,56%	9,35%	16,59%
Benchmark:	CDI					0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%
Renda Fixa CDI	702.208,15	100%			0,02%							
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	111.263,41	15,85%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,18%	0,60%	1,46%	1,83%	4,02%	10,43%	18,07%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	590.944,74	84,16%	VOTORANTIM	0,33%	0,02%	0,22%	0,51%	1,19%	1,58%	3,80%	10,43%	18,40%
Benchmark:	CDI					0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%
Total	702.139,86	100%			0,02%	0,22%	0,52%	1,23%	1,62%	3,56%	9,36%	16,59%
Benchmark:	CDI					0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%

* 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.

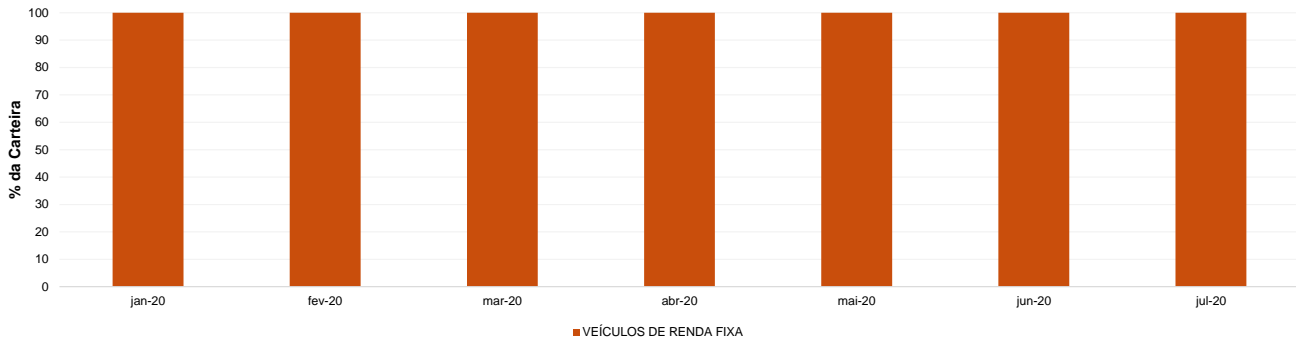
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/07/2020

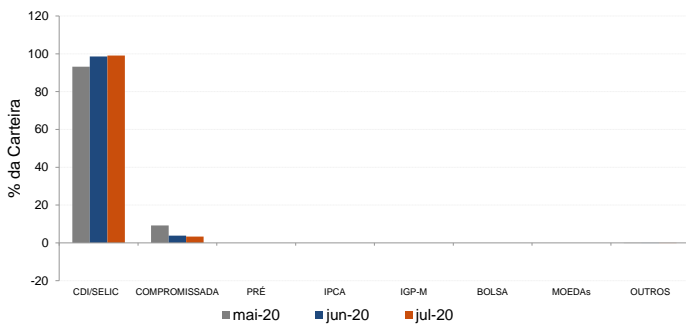
Distribuição da Carteira

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.

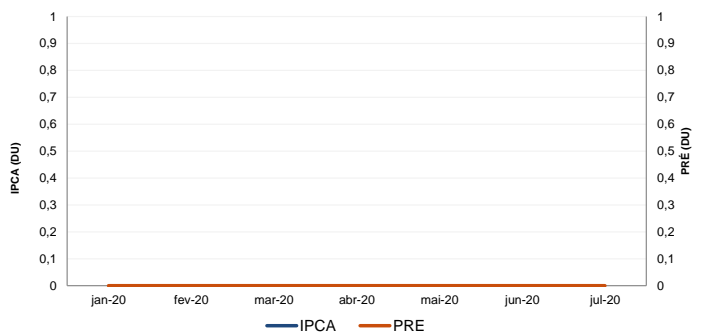
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/07/2020

Análises de Contrapartes

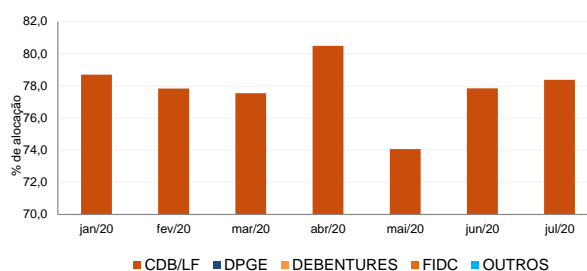
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	88,83	12,66	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	62,37	8,89	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	44,72	6,37	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	42,19	6,01	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	39,57	5,64	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	38,99	5,56	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	36,45	5,19	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	34,87	4,97	Faixa 2
BCO ITAU SA	34,76	4,95	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	29,43	4,19	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: 31/07/2020

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 2020-09-01	01-set-20	288	0,04%	Selic	07-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	5	0,00%	Selic	01-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	4	0,00%	Selic	01-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	08-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	23-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	28-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	17-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	29-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	07-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	14-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	03-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	07-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	17-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	01-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	22-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	27-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	16-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	30-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	07-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	07-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	08-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	23-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	28-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	08-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	10-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	15-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	20-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	20-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	22-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	03-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	24-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	16-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	24-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.799	0,68%	Selic	30-jul-20	0,03%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.294	0,47%	Selic	30-jul-20	0,03%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	486	0,07%	Selic	06-jul-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-set-22	113	0,02%	Selic	06-jul-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.178	0,31%	Selic	03-jul-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	809	0,12%	Selic	20-jul-20	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	65	0,01%	Selic	06-jul-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	1.087	0,15%	Selic	03-jul-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT