

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2020

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	89.466.197,53	85,08%										
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,51%	0,28%	1,55%	1,55%	5,21%	11,97%	20,35%
Renda Fixa Total Return	89.466.197,53	85,08%			0,56%	0,63%	1,21%	0,34%	0,34%	4,22%	15,05%	24,09%
ATLANTIDA FI MULT	47.343.021,86	45,02%	ITAU	44,08%	0,55%	0,44%	1,04%	1,07%	1,07%	5,27%	16,46%	25,40%
ITAPEMA FI MULT	42.123.175,67	40,06%	SUL AMERICA	41,97%	0,58%	0,51%	1,07%	-0,79%	-0,79%	2,71%	13,11%	22,26%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,51%	0,28%	1,55%	1,55%	5,21%	11,97%	20,35%
Estruturado	15.694.523,76	14,92%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,46%	1,46%	3,24%	3,24%	7,77%	17,98%	30,42%
Multimercado Estruturado	15.694.523,76	14,92%			0,90%	0,47%	1,87%	-0,62%	-0,62%	4,31%	11,68%	20,21%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	3.283.063,90	3,12%	ABSOLUTE	0,41%	0,78%	0,08%	0,43%	1,22%	1,22%	6,20%	14,96%	26,12%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	1.963.600,80	1,87%	AZ QUEST	0,25%	1,78%	0,42%	2,23%	0,67%	0,67%	5,97%	14,44%	30,94%
KINEA CHRONOS FI MULT	9.420.719,94	8,96%	KINEA	0,11%	1,30%	0,81%	2,64%	-1,72%	-1,72%	3,33%	12,40%	26,26%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	1.027.139,12	0,98%	SPX	0,07%	17,30%	1,15%	1,39%	2,89%	2,89%	5,41%	6,64%	23,79%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,46%	1,46%	3,24%	3,24%	7,77%	17,98%	30,42%
Total	105.156.932,91	100%			0,57%	0,49%	1,19%	0,09%	0,09%	4,03%	14,47%	23,48%
Benchmark:	IPCA + 3.15% a.a.					0,52%	0,32%	1,62%	1,62%	5,36%	12,30%	20,88%

* 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.

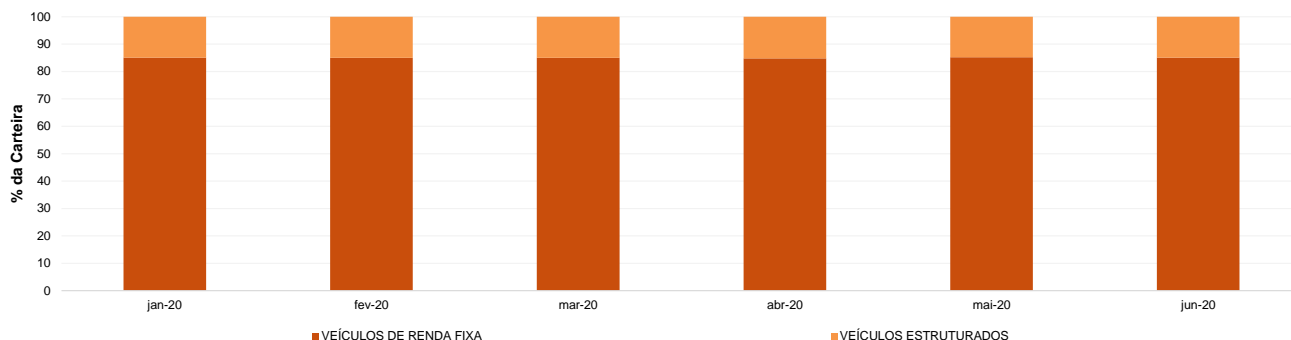
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

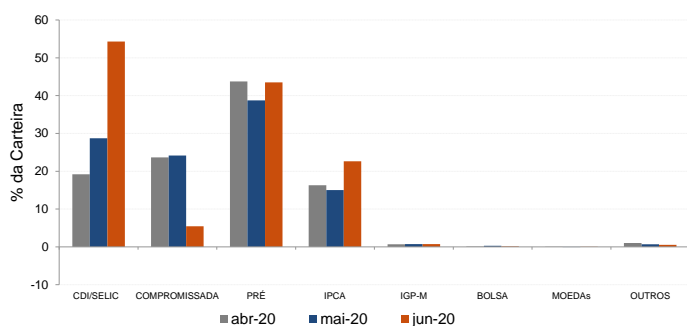
Distribuição da Carteira

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.

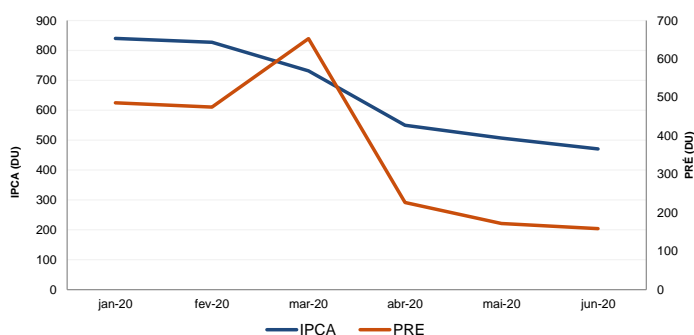
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	164,33	23,17	163,06	26,90
GBIO33	Medicamentos e Outros Produtos	58,09	8,19	58,20	9,60
JBSS3	Alimentos Processados	42,57	6,00	10,06	1,66
COCE5	Energia Elétrica	33,07	4,66	30,38	5,01
QUAL3	Análises e Diagnósticos	28,04	3,95	17,88	2,95
MGLU3	Comércio	27,96	3,94	27,38	4,52
GNDI3	Análises e Diagnósticos	24,44	3,45	10,00	1,65
TGMA3	Transporte	23,94	3,37	16,81	2,77
PCAR3	Comércio e Distribuição	23,18	3,27	11,22	1,85
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	22,33	3,15	14,22	2,34

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

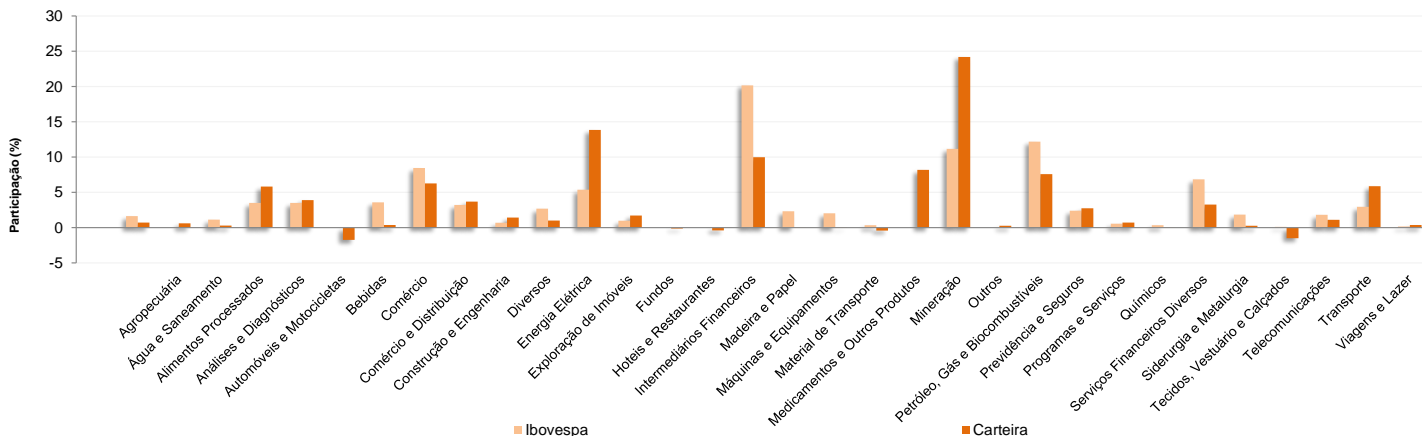
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BPAC13	17,68	2,49	0,00	Sem Liquidez
VALE3	164,33	23,17	0,00	1
GBIO33	58,09	8,19	0,00	1
JBSS3	42,57	6,00	0,00	1
COCE5	33,07	4,66	0,00	1
QUAL3	28,04	3,95	0,00	1
MGLU3	27,96	3,94	0,00	1
GNDI3	24,44	3,45	0,00	1
TGMA3	23,94	3,37	0,00	1
PCAR3	23,18	3,27	0,00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Este 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.

Análises de Contrapartes

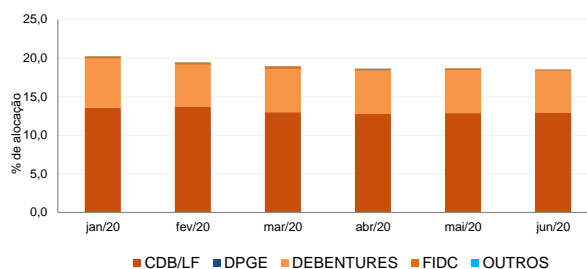
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.864,01	3,65	Faixa 2
BCO ITAU SA	3.535,88	3,34	Faixa 2
BCO BRASIL SA	2.388,62	2,26	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.071,62	1,96	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.355,98	1,28	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.253,20	1,18	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.008,93	0,95	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	617,02	0,58	Faixa 2
RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	431,02	0,41	Faixa 1
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	399,68	0,38	Faixa 1

* 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 PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2020

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	18.787	0,02%	Selic	04-jun-20	0,02%	0,01%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	356.916	0,34%	Selic	15-jun-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	9.393	0,01%	Selic	02-jun-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	4.696	0,00%	Selic	23-jun-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	75.120	0,07%	Selic	30-jun-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	42.255	0,04%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	13.017.530	12,30%	Selic	22-jun-20	4,00%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.258.465	1,19%	Selic	02-jun-20	4,00%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	3.179.736	3,01%	IPCA	25-jun-20	0,78%	0,61%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2.597.554	2,46%	IPCA	26-jun-20	0,70%	0,60%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	649.801	0,61%	IPCA	26-jun-20	0,70%	0,60%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	3.298	0,00%	IPCA	26-jun-20	0,69%	0,60%	ATLANTIDA FI MULT