

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	701.364,03	100%				0,06%	0,48%	1,40%	1,40%	3,87%	9,67%	17,24%
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%
Renda Fixa CDI	701.364,03	100%			0,02%							
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	111.736,08	15,93%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,20%	0,69%	1,65%	1,65%	4,41%	10,82%	18,80%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	589.627,95	84,08%	VOTORANTIM	0,33%	0,02%	0,04%	0,45%	1,36%	1,36%	4,17%	10,81%	19,10%
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%
Total	701.300,83	100%			0,02%	0,06%	0,48%	1,40%	1,40%	3,87%	9,67%	17,24%
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%

* 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.

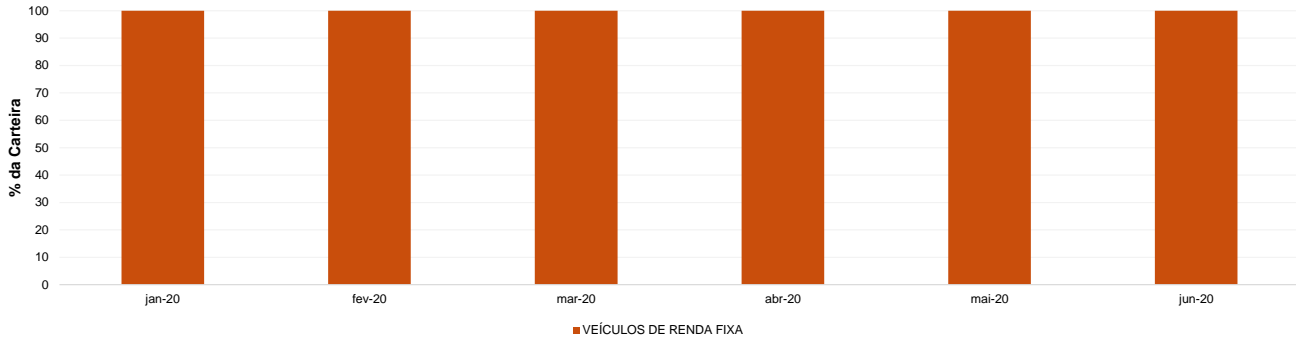
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/06/2020

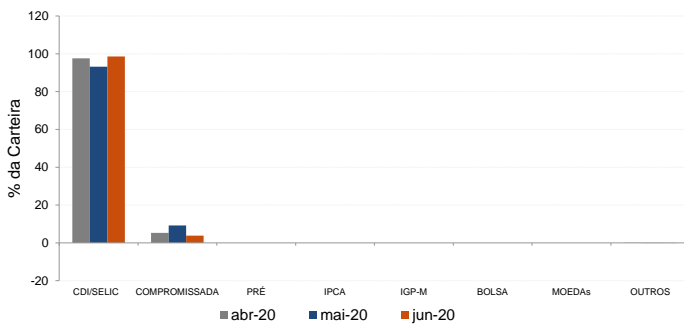
Distribuição da Carteira

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.

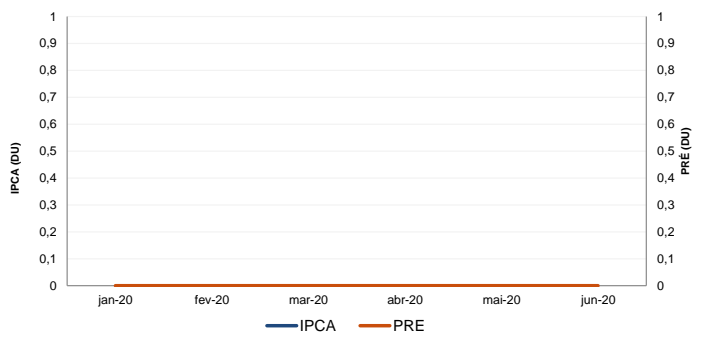
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/06/2020

Análises de Contrapartes

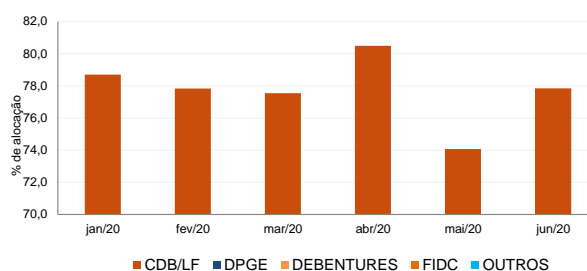
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	88,16	12,57	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	61,84	8,82	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	44,37	6,33	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	41,87	5,97	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	39,27	5,60	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	38,69	5,52	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	36,17	5,16	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	34,61	4,94	Faixa 2
BCO ITAU SA	34,50	4,92	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	29,20	4,16	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: 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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	08-mar-24	16.143	2,30%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	23-jun-20	1,86%	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	4	0,00%	Selic		10-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		15-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic		22-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic		05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		09-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		10-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		18-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		08-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		09-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		18-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		01-jun-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		24-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		29-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		05-jun-20	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.441	0,21%	Selic		24-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	649	0,09%	Selic		02-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	259	0,04%	Selic		02-jun-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	499	0,07%	Selic		02-jun-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	288	0,04%	Selic		02-jun-20	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	791	0,11%	Selic		02-jun-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	33.301	4,75%	Selic		04-jun-20	0,03%	0,00%	BV BANKS RF CRED PRIV FI