

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

Data-base: 29/05/2020

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	217.570.361,55	81,91%				0,60%	-1,13%	0,61%	-0,23%	4,85%	13,72%	23,17%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					-0,15%	0,11%	2,45%	1,04%	4,92%	13,09%	19,77%
Renda Fixa Total Return	207.746.702,44	78,22%			0,56%	0,62%	-1,20%	0,51%	-0,31%	4,80%	14,36%	24,30%
ATLANTIDA FI MULT	107.362.626,83	40,42%	ITAU	100%	0,33%	0,55%	-0,51%	1,45%	0,63%	6,06%	16,47%	25,47%
ITAPEMA FI MULT	100.384.075,61	37,79%	SUL AMERICA	100%	0,84%	0,69%	-1,92%	-0,47%	-1,29%	3,47%	12,24%	22,95%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					-0,15%	0,11%	2,45%	1,04%	4,92%	13,09%	19,77%
Renda Fixa ALM	6.088.201,59	2,29%				0,09%	1,36%	4,79%	3,34%	8,97%	21,91%	34,92%
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.088.201,59	2,29%		100%		0,09%	1,36%	4,79%	3,34%	8,97%	21,91%	34,92%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					-0,04%	0,44%	3,13%	1,59%	6,33%	16,15%	24,65%
Renda Fixa CDI	1.552.517,14	0,58%			0,18%	0,12%	-1,74%	-0,74%	-1,09%	1,92%	9,15%	17,77%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	262.278,05	0,10%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,23%	0,84%	1,87%	1,50%	4,81%	11,44%	20,04%
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.290.239,10	0,49%	BTG PACTUAL	0,15%	0,22%	-0,07%	-5,72%	-4,75%	-5,06%	-2,48%	4,92%	14,24%
Benchmark:	CDI					0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%
RF REFERENCIADO DI	2.182.940,37	0,82%				0,23%	0,82%	1,83%	1,46%	4,71%	11,22%	19,67%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.182.940,37	0,82%	ITAU	0,01%	0,01%	0,23%	0,82%	1,83%	1,46%	4,71%	11,22%	19,67%
Benchmark:	CDI					0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%
Renda Variável	15.592.589,92	5,87%				9,28%	-21,90%	-21,35%	-27,31%	-9,29%	17,70%	38,57%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					8,82%	-15,49%	-18,07%	-23,51%	-7,23%	20,78%	52,21%
Renda Variável Ativa	15.592.589,92	5,87%			31,59%	9,28%	-21,90%	-21,35%	-27,31%	-9,29%	17,87%	43,56%
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.716.061,18	1,02%	AZ QUEST	0,36%	31,85%	9,33%	-21,39%	-19,52%	-25,16%	-9,51%	10,88%	50,55%
BRADESCO FIA SELECTION	2.563.412,87	0,97%	BRADESCO	0,40%	32,89%	7,86%	-21,10%	-25,75%	-30,73%	-17,66%	4,91%	43,56%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.896.254,90	1,47%	BTG PACTUAL	0,22%	29,21%	10,28%	-12,27%	-10,89%	-16,87%	3,46%	41,18%	67,32%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	3.684.461,10	1,39%	ITAU	0,23%	35,33%	9,18%	-30,73%	-29,72%	-36,23%	-18,72%	6,36%	36,83%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	2.732.399,86	1,03%	NEO GESTAO	0,53%	29,56%	9,29%	-23,28%	-21,23%	-26,77%	-4,57%	21,34%	34,46%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					8,82%	-15,49%	-18,07%	-23,51%	-7,23%	20,78%	52,21%
Estruturado	32.455.993,43	12,22%				0,46%	-0,84%	0,68%	-0,99%	5,19%	12,61%	22,62%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,47%	1,60%	3,41%	2,77%	8,02%	18,33%	31,20%
Multimercado Estruturado	32.455.993,43	12,22%			1,13%	0,46%	-0,84%	0,68%	-0,99%	5,19%	12,22%	21,98%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	5.485.848,82	2,07%	ABSOLUTE	0,72%	0,96%	-0,68%	0,39%	2,62%	1,14%	6,85%	16,09%	27,49%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	4.089.703,23	1,54%	AZ QUEST	0,52%	1,43%	1,17%	-1,37%	1,98%	0,25%	7,80%	15,40%	31,31%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	2.512.495,37	0,95%	ITAU	0,05%	8,14%	0,64%	-0,63%	0,51%	-1,34%	6,06%	20,49%	34,10%
KINEA CHRONOS FI MULT	19.352.435,90	7,29%	KINEA	0,22%	1,86%	0,67%	-1,52%	-0,64%	-2,51%	3,91%	12,26%	26,30%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	1.015.510,10	0,38%	SPX	0,07%	4,35%	-0,92%	0,44%	2,37%	1,73%	5,72%	7,82%	24,01%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,47%	1,60%	3,41%	2,77%	8,02%	18,33%	31,20%
Total	265.609.264,51	100%			2,28%	1,05%	-2,68%	-1,08%	-2,44%	3,75%	13,70%	22,87%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					-0,04%	0,44%	3,13%	1,59%	6,33%	16,15%	24,65%

* 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 EFFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

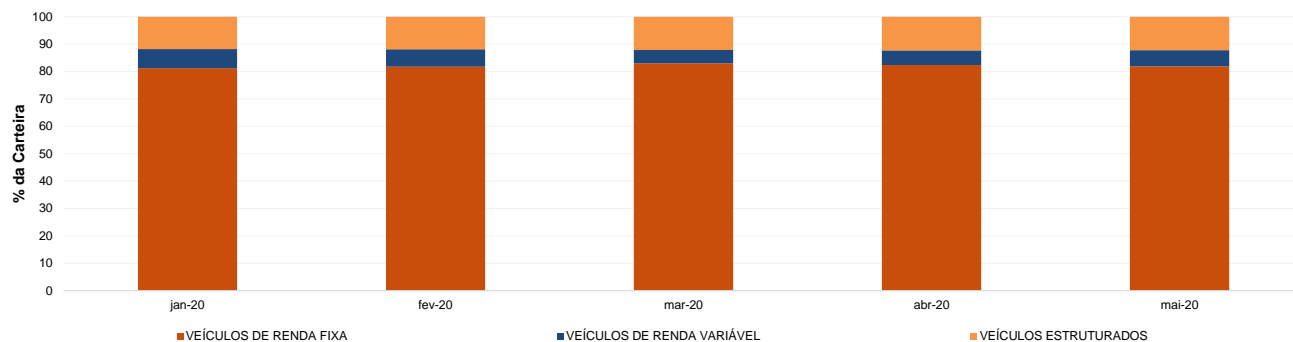
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

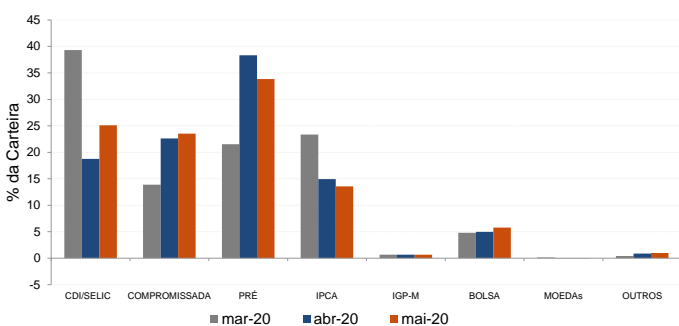
Distribuição da Carteira

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.

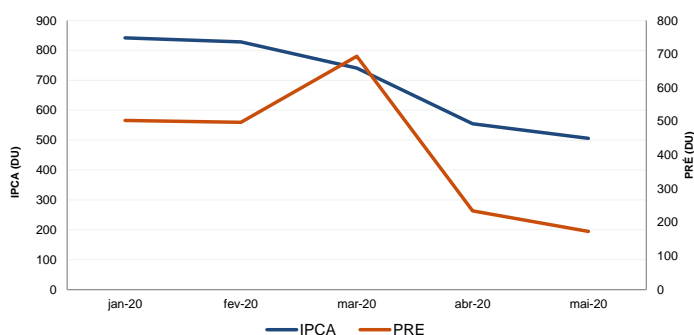
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	1.405,66	8,30	1.215,75	8,05
MGLU3	Comércio	1.375,30	8,12	1.065,87	7,06
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.075,00	6,34	732,74	4,85
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	712,11	4,20	121,73	0,81
RENT3	Diversos	650,18	3,84	646,63	4,28
EQTL3	Energia Elétrica	600,76	3,55	574,01	3,80
LAME4	Comércio	595,44	3,51	468,76	3,11
UGPA3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	518,42	3,06	427,56	2,83
LREN3	Comércio	515,75	3,04	625,85	4,15
NTCO3	Farmacêutico e Higiene	476,07	2,81	365,03	2,42

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

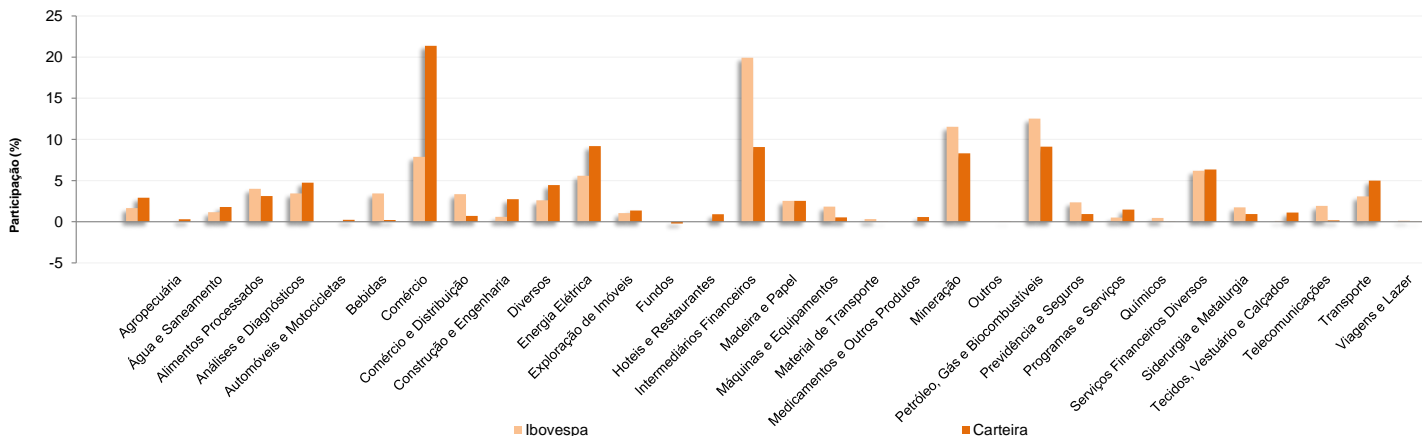
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CPRE3	4,37	0,03	0,09	3
VALE3	1.405,66	8,30	0,00	1
MGLU3	1.375,30	8,12	0,00	1
B3SA3	1.075,00	6,34	0,00	1
PETR4	712,11	4,20	0,00	1
RENT3	650,18	3,84	0,00	1
EQTL3	600,76	3,55	0,00	1
LAME4	595,44	3,51	0,00	1
UGPA3	518,42	3,06	0,00	1
LREN3	515,75	3,04	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

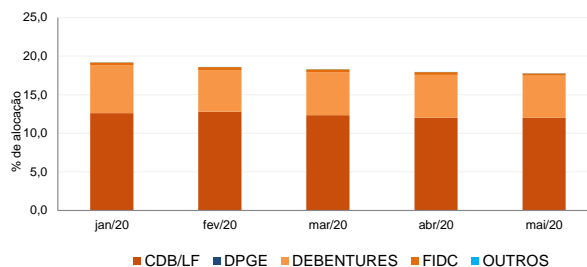
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	9.559,11	3,58	Faixa 2
BCO ITAU SA	8.260,73	3,10	Faixa 2
BCO BRASIL SA	5.952,07	2,23	Faixa 2
BCO SAFRA SA	4.696,53	1,76	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	3.946,08	1,48	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	2.999,65	1,12	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.284,07	0,86	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.128,12	0,80	Faixa 2
VALE SA	1.405,68	0,53	Faixa 1
MAGAZINE LUIZA SA	1.375,30	0,52	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 PLANO CV

Data-base: 29/05/2020

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	53.157	0,02%	Selic	08-mai-20	0,01%	0,01%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2020-09-01	01-set-20	10.631	0,00%	Selic	22-mai-20	0,01%	0,01%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2020-09-01	01-set-20	10.631	0,00%	Selic	27-mai-20	0,01%	0,01%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	414.586	0,16%	Selic	15-mai-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	116.935	0,04%	Selic	14-mai-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	31.891	0,01%	Selic	11-mai-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	21.261	0,01%	Selic	06-mai-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.852	0,00%	Selic	29-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.256	0,00%	Selic	20-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.115	0,00%	Selic	20-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	10.628	0,00%	Selic	26-mai-20	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.820	0,00%	Selic	15-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.819	0,00%	Selic	15-mai-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.255	0,00%	Selic	21-mai-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	687.708	0,26%	IPCA	05-mai-20	1,84%	1,79%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	364.694	0,14%	IPCA	18-mai-20	1,42%	1,23%	ATLANTIDA FI MULT