

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	713.435,96	100%			0,24%	0,65%	1,65%	1,33%	4,24%	10,04%	18,10%	
Benchmark:	CDI				0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	
Renda Fixa CDI	713.435,96	100%		0,01%								
BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	124.036,98	17,39%	BRABESCO	0,00%	0,01%	0,22%	0,81%	1,81%	1,44%	4,67%	11,15%	19,58%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	589.398,97	82,62%	VOTORANTIM	0,33%	0,01%	0,25%	0,62%	1,65%	1,32%	4,63%	11,33%	20,04%
Benchmark:	CDI				0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	
Total	713.375,13	100%		0,01%	0,24%	0,65%	1,65%	1,33%	4,24%	10,04%	18,10%	
Benchmark:	CDI				0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	

* 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.

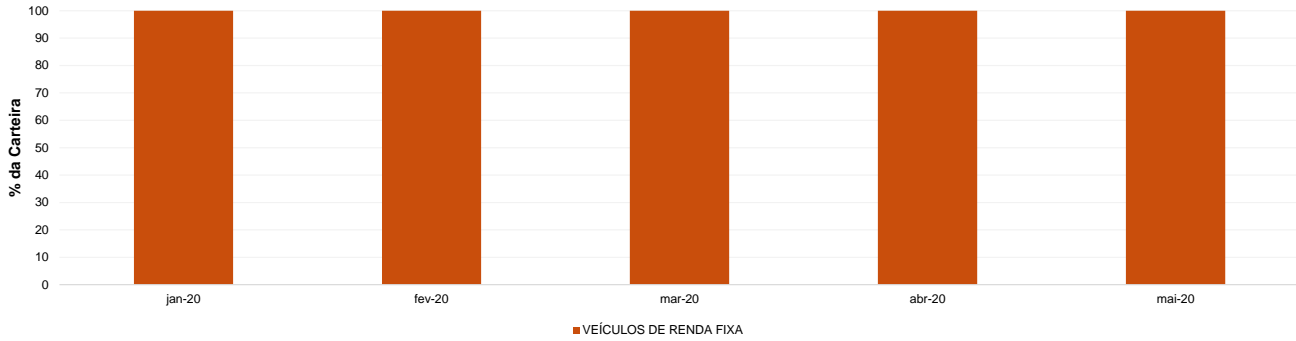
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/05/2020

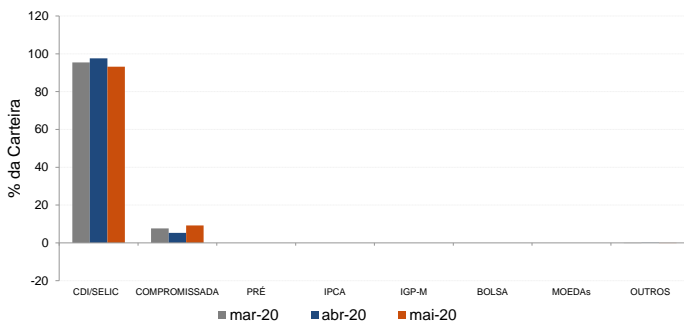
Distribuição da Carteira

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.

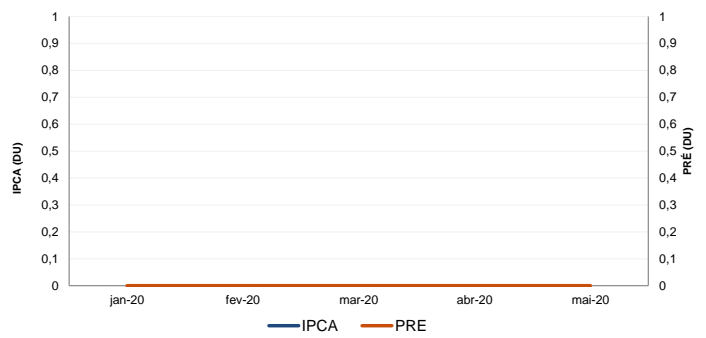
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/05/2020

Análises de Contrapartes

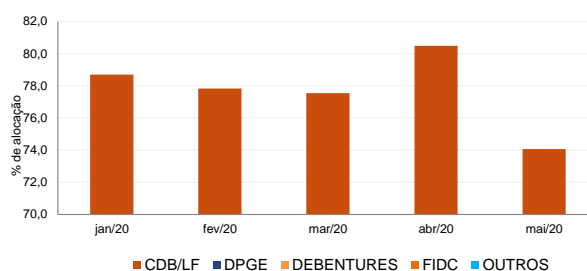
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	87,79	12,33	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	45,47	6,39	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	44,18	6,20	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	41,69	5,85	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	39,11	5,49	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	38,53	5,41	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	36,02	5,06	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	34,46	4,84	Faixa 2
BCO ITAU SA	34,36	4,82	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	29,08	4,08	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: 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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	12-jul-21	4.988	0,70%	CDI	BCO SAFRA SA	06-mai-20	0,05%	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		04-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		25-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic		04-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic		14-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		04-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		08-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		08-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		22-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		18-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		04-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic		08-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic		08-mai-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.281	0,18%	Selic		19-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.033	0,14%	Selic		20-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	240	0,03%	Selic		26-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	125	0,02%	Selic		26-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.201	0,45%	Selic		06-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.600	0,22%	Selic		15-mai-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.600	0,22%	Selic		15-mai-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.880	0,40%	Selic		21-mai-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.599	0,22%	Selic		12-mai-20	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	12.309	1,73%	Selic		08-mai-20	0,03%	0,00%	BV BANKS RF CRED PRIV FI

