

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2020

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	712.333,50	100%			0,23%	0,91%	1,98%	0,91%	4,78%	10,51%	19,62%	
Benchmark:	CDI				0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%	
Renda Fixa CDI	712.333,50	100%		0,02%								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	125.341,80	17,60%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,32%	0,95%	2,16%	0,95%	5,24%	11,72%	21,04%
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	586.991,71	82,41%	VOTORANTIM	0,36%	0,02%	0,21%	0,90%	2,12%	0,90%	5,32%	12,02%	21,67%
Benchmark:	CDI				0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%	
Total	712.265,18	100%		0,02%	0,23%	0,91%	1,98%	0,91%	4,78%	10,51%	19,62%	
Benchmark:	CDI				0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%	

* 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.

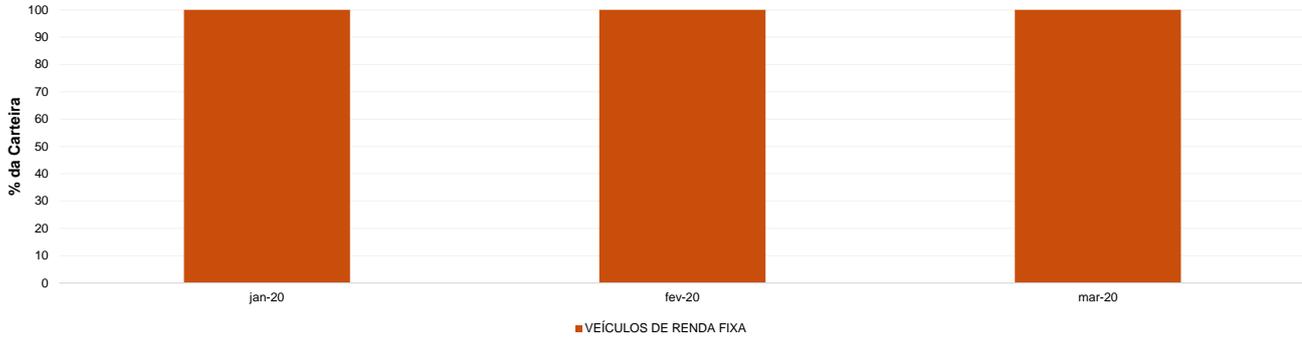
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

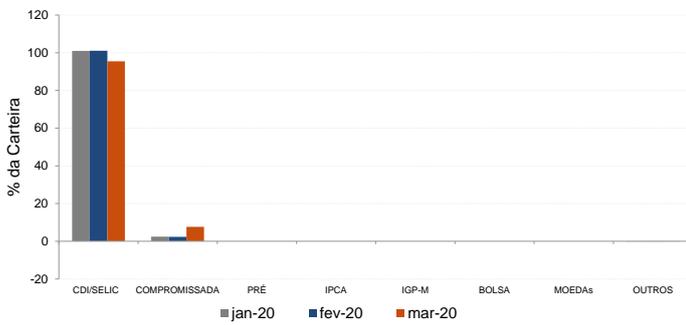
Distribuição da Carteira

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.

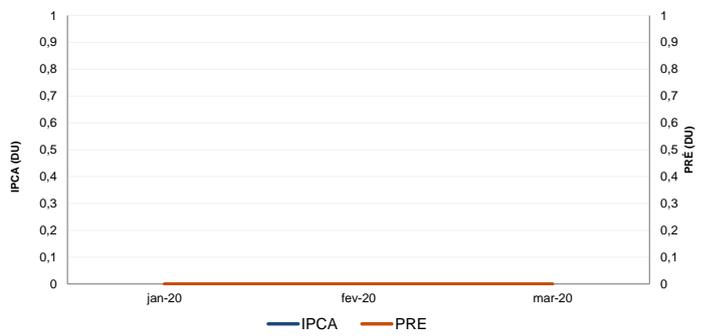
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2020

Análises de Contrapartes

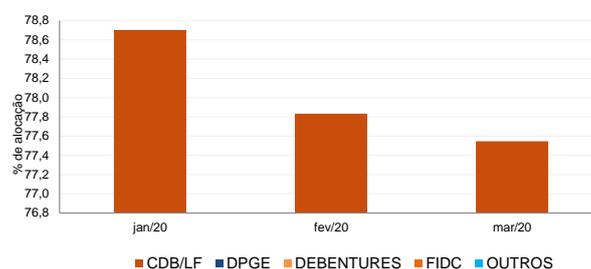
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO VOTORANTIM SA	69,72	9,80	Faixa 2
BCO SAFRA SA	59,25	8,33	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	44,60	6,27	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	41,84	5,88	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	41,22	5,80	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	38,53	5,42	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	36,93	5,19	Faixa 2
BCO ITAU SA	36,75	5,17	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	35,62	5,01	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	31,11	4,37	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: 31/03/2020

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	492	0,07%	Selic	03-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	7	0,00%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	5	0,00%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	4	0,00%	Selic	17-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	4	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	06-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	3	0,00%	Selic	25-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	12-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	25-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	09-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	09-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	2	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	06-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	06-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	09-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	24-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	24-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	25-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	27-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	12-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	05-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	16-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	19-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	03-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	26-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	19-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	10-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	11-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	10-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	0	0,00%	Selic	06-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.568	0,36%	Selic	26-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.302	0,32%	Selic	10-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	189	0,03%	Selic	18-mar-20	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	566	0,08%	Selic	26-mar-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT