

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/10/2020

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	87.623.188,45	85,38%										
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					1,11%	2,50%	3,52%	4,75%	7,01%	13,02%	21,68%
Renda Fixa Total Return	87.623.188,45	85,38%			0,55%	0,16%	0,42%	2,18%	1,26%	1,85%	12,82%	20,83%
ATLANTIDA FI MULT	46.171.547,90	44,99%	ITAU	44,90%	0,69%	0,47%	0,73%	2,13%	2,21%	3,05%	14,28%	23,05%
ITAPEMA FI MULT	41.451.640,56	40,39%	SUL AMERICA	43,86%	0,49%	-0,17%	0,09%	1,90%	-0,11%	0,18%	10,84%	18,19%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					1,11%	2,50%	3,52%	4,75%	7,01%	13,02%	21,68%
Estruturado	15.007.863,98	14,62%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,22%	2,65%	4,99%	6,29%	16,28%	27,59%
Multimercado Estruturado	15.007.863,98	14,62%			0,85%	-0,15%	-0,68%	1,22%	-0,23%	1,36%	9,31%	15,76%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	3.304.455,23	3,22%	ABSOLUTE	0,34%	0,61%	0,11%	0,03%	0,04%	1,88%	3,87%	12,18%	22,86%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	1.225.397,47	1,19%	AZ QUEST	0,15%	0,98%	-0,41%	-0,82%	1,96%	1,04%	2,61%	11,59%	22,49%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	1.036.774,29	1,01%	ITAU	0,02%	1,24%	0,00%	-0,37%	2,75%	0,73%	2,71%	14,30%	29,76%
KINEA CHRONOS FI MULT	9.441.236,99	9,20%	KINEA	0,13%	1,07%	-0,22%	-0,95%	1,71%	-1,50%	0,04%	9,39%	19,31%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,22%	2,65%	4,99%	6,29%	16,28%	27,59%
Total	102.627.312,13	100%			0,57%	0,11%	0,24%	1,89%	0,88%	1,54%	12,17%	19,87%
Benchmark:	IPCA + 3.15% a.a.					1,12%	2,54%	3,60%	4,88%	7,17%	13,34%	22,21%

* 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.

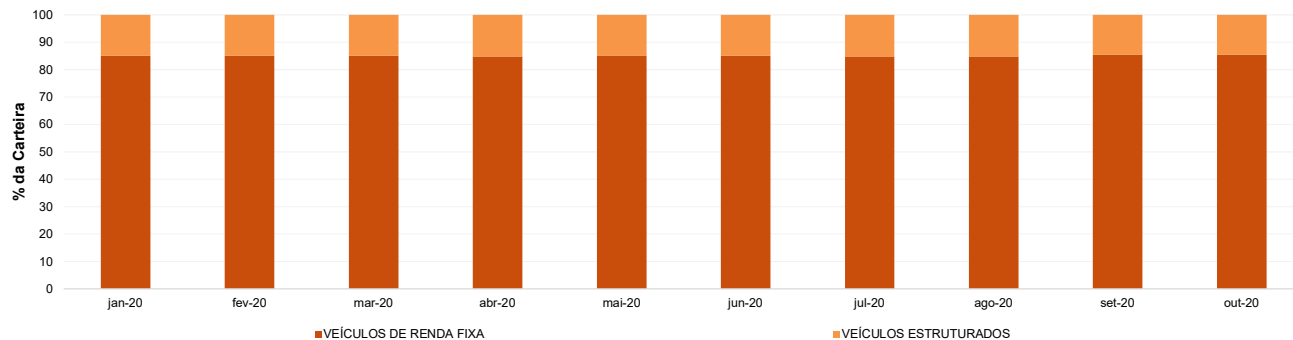
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

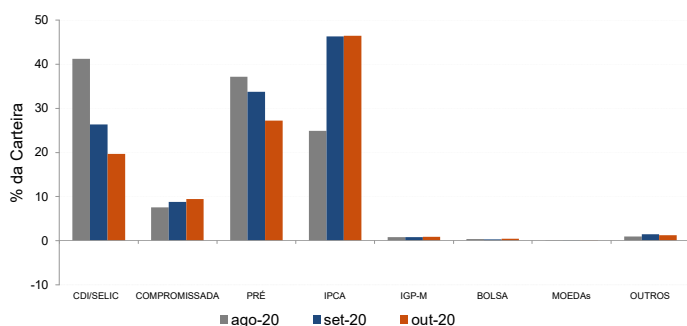
Distribuição da Carteira

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.

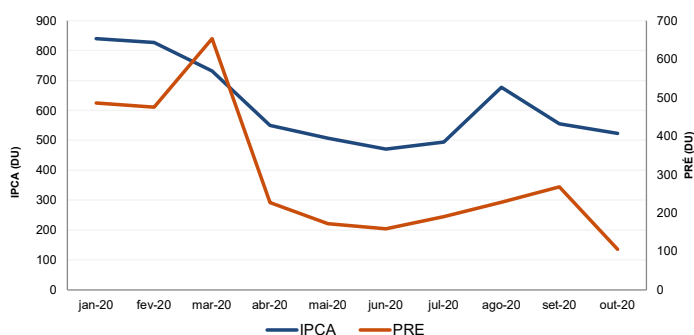
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



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	102,66	10,91	85,05	10,15
LINX3	Programas e Serviços	94,44	10,04	75,90	9,06
LCAM3	Diversos	52,26	5,55	33,60	4,01
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	49,81	5,29	41,69	4,98
FLRY3	Análises e Diagnósticos	44,87	4,77	39,10	4,67
CRFB3	Comércio e Distribuição	41,17	4,38	41,43	4,94
ALUP11	Energia Elétrica	36,60	3,89	39,38	4,70
BPAC11	Intermediários Financeiros	31,65	3,36	41,73	4,98
VIVT4	Telecomunicações	29,01	3,08	28,79	3,44
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	28,06	2,98	25,64	3,06

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

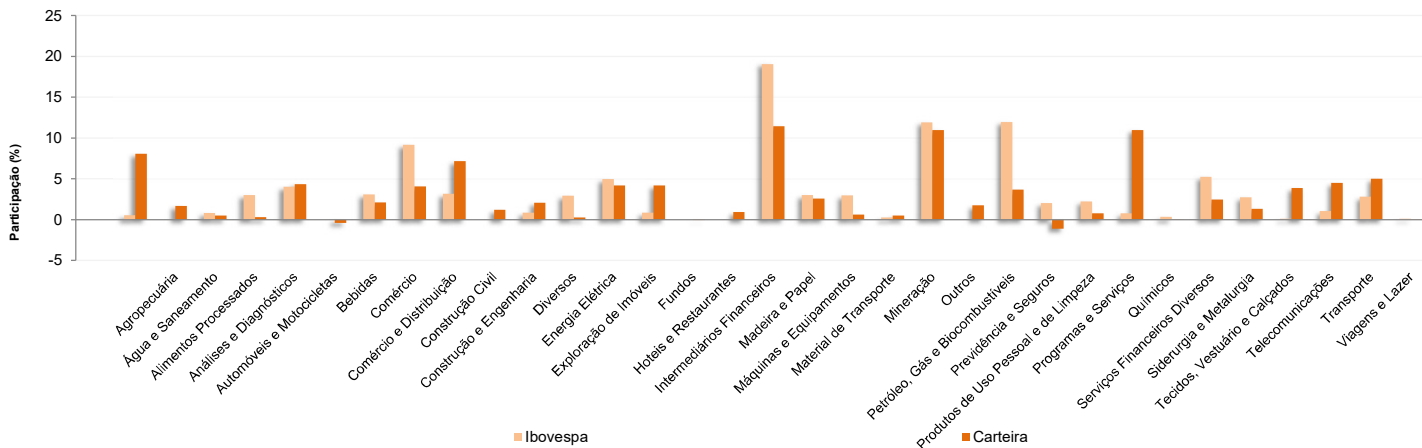
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	102,66	10,91	0,00	1
LINX3	94,44	10,04	0,00	1
LCAM3	52,26	5,55	0,00	1
PETR3	49,81	5,29	0,00	1
FLRY3	44,87	4,77	0,00	1
CRFB3	41,17	4,38	0,00	1
ALUP11	36,60	3,89	0,00	1
BPAC11	31,65	3,36	0,00	1
VIVT4	29,01	3,08	0,00	1
BRDT3	28,06	2,98	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.



Análises de Contrapartes

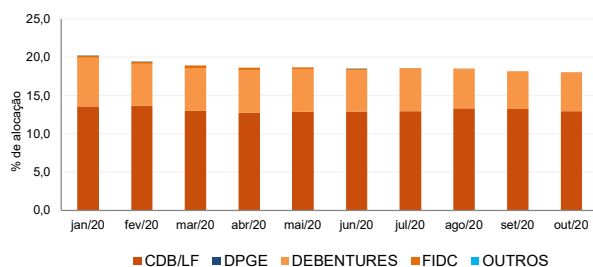
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.863,31	3,76	Faixa 2
BCO ITAU SA	3.426,23	3,33	Faixa 2
BCO BRASIL SA	2.528,88	2,46	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.977,13	1,92	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.370,73	1,33	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.028,82	1,00	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	976,00	0,95	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	626,38	0,61	Faixa 2
RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	434,58	0,42	Faixa 1
CCR SA	419,15	0,41	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 PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/10/2020

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 2021-03-01	01-mar-21	33.708	0,03%	Selic	05-out-20	0,11%	0,14%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	19.262	0,02%	Selic	20-out-20	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	24.044	0,02%	Selic	26-out-20	0,10%	0,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	409.267	0,40%	IPCA	09-out-20	2,03%	-2,33%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	28.499	0,03%	IPCA	06-out-20	0,23%	0,26%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	384.053	0,37%	IPCA	09-out-20	2,34%	2,25%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	44.474	0,04%	IPCA	09-out-20	4,30%	4,27%	ATLANTIDA FI MULT

