

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	109.712.095,51	74,10%											
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					1,11%	2,50%	3,52%	4,75%	7,01%	13,02%	21,68%	
Renda Fixa Total Return	109.712.095,51	74,10%			0,55%	0,15%	0,41%	2,01%	1,05%	1,62%	12,56%	20,50%	
ATLANTIDA FI MULT	56.653.686,51	38,27%	ITAU	55,10%	0,69%	0,47%	0,73%	2,13%	2,21%	3,05%	14,28%	23,05%	
ITAPEMA FI MULT	53.058.409,00	35,84%	SUL AMERICA	56,14%	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%	
Renda Variável	17.550.803,47	11,85%											
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-0,44%	-8,03%	18,45%	-16,74%	-9,77%	13,99%	38,10%	
Renda Variável Ativa	17.550.803,47	11,85%			8,87%	-0,24%	-5,74%	23,40%	-17,51%	-9,89%	18,55%	38,84%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.968.604,33	2,01%	AZ QUEST	0,41%	8,08%	-0,62%	-8,62%	19,50%	-18,20%	-12,58%	6,60%	33,64%	
BRADESCO FIA SELECTION	3.053.495,73	2,06%	BRADESCO	0,43%	8,88%	3,33%	-0,65%	28,48%	-17,49%	-12,83%	6,67%	36,20%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	4.420.883,97	2,99%	BTG PACTUAL	0,20%	9,50%	-1,73%	-5,06%	25,13%	-5,68%	1,35%	39,74%	63,12%	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	240.992,17	0,16%	ITAU	0,02%	10,58%	-4,17%	-15,33%	9,64%	-35,96%	-27,31%	-4,47%	14,77%	
ITAU ACOES DUNAMIS INSTITUCIONAL FC	3.461.625,85	2,34%	ITAU	2,07%	8,09%	0,26%	-5,15%	17,73%	-	-	-	-	
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3.405.201,41	2,30%	NEO GESTAO	0,59%	9,69%	1,78%	2,28%	36,20%	-8,74%	0,08%	42,18%	40,10%	
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-0,44%	-8,03%	18,45%	-16,74%	-9,77%	13,99%	38,10%	
Estruturado	17.793.301,99	12,02%											
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,22%	2,65%	4,99%	6,29%	16,28%	27,59%	
Multimercado Estruturado	17.793.301,99	12,02%			0,82%	-0,18%	-0,74%	1,66%	0,26%	1,67%	9,66%	17,30%	
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	2.221.389,64	1,50%	ABSOLUTE	0,23%	0,61%	0,11%	0,03%	0,04%	1,88%	3,87%	12,18%	22,86%	
AZ QUEST MULT FC FI MULT	2.896.351,31	1,96%	AZ QUEST	0,35%	0,98%	-0,41%	-0,82%	1,96%	1,04%	2,61%	11,59%	22,49%	
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	2.565.081,01	1,73%	ITAU	0,05%	1,24%	0,00%	-0,37%	2,75%	0,73%	2,71%	14,30%	29,76%	
KINEA CHRONOS FI MULT	10.110.480,02	6,83%	KINEA	0,14%	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	148.052.602,54	100%			1,45%	0,02%	-0,55%	3,92%	-1,55%	0,10%	13,02%	21,12%	
Benchmark:	IPCA + 4,15% a.a.					1,20%	2,79%	4,10%	5,72%	8,20%	15,54%	25,78%	

* 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.

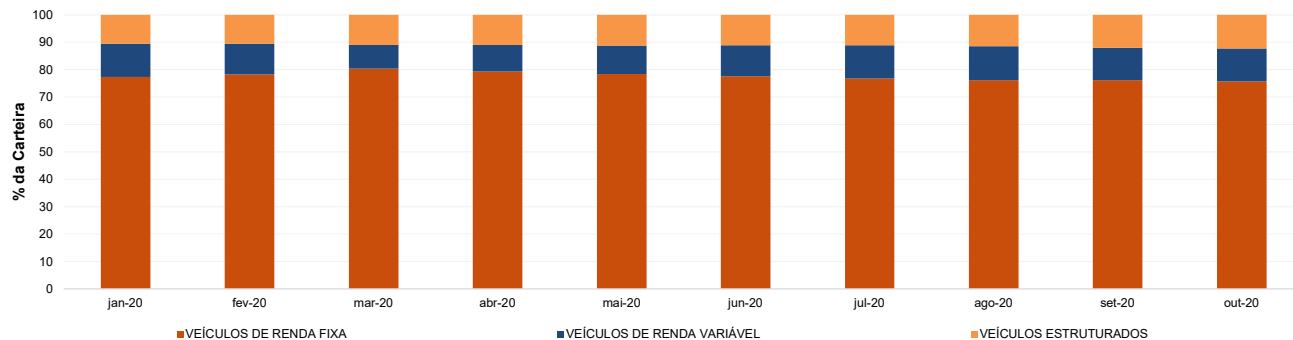
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

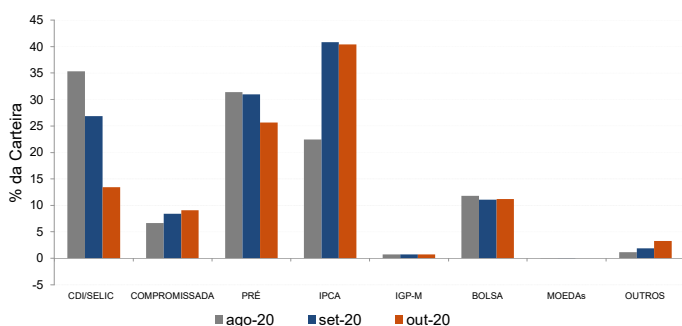
Distribuição da Carteira

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.

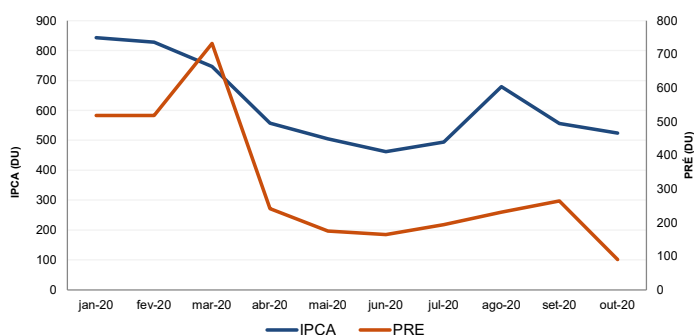
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
MGLU3	Comércio	1.692,41	9,32	1.467,33	8,19
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	1.203,02	6,63	1.186,86	6,62
VALE3	Mineração	1.031,09	5,68	1.286,36	7,18
RENT3	Diversos	976,44	5,38	827,81	4,62
SUZB3	Madeira e Papel	770,41	4,24	132,00	0,74
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	657,45	3,62	730,90	4,08
PETZ3	Comércio	593,02	3,27	372,72	2,08
EQTL3	Energia Elétrica	589,26	3,25	614,68	3,43
HAPV3	Análises e Diagnósticos	482,27	2,66	451,06	2,52
TOTS3	Programas e Serviços	476,53	2,62	212,76	1,19

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

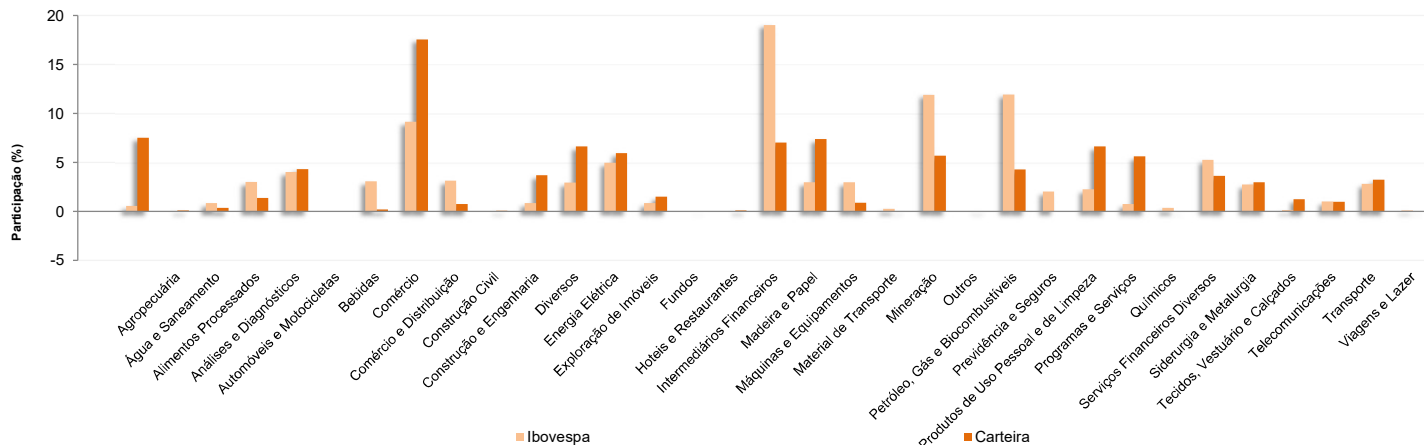
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MGLU3	1.692,41	9,32	0,00	1
NTCO3	1.203,02	6,63	0,00	1
VALE3	1.031,09	5,68	0,00	1
RENT3	976,44	5,38	0,00	1
SUZB3	770,41	4,24	0,00	1
B3SA3	657,45	3,62	0,00	1
PETZ3	593,02	3,27	0,02	1
EQTL3	589,26	3,25	0,00	1
HAPV3	482,27	2,66	0,00	1
TOTS3	476,53	2,62	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

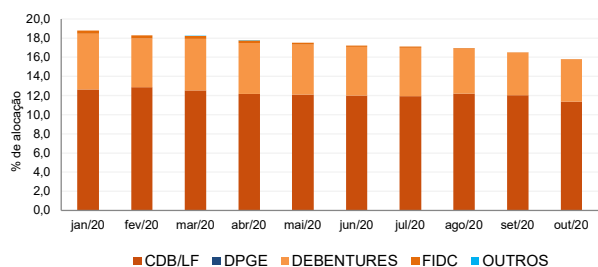
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	5.131,56	3,46	Faixa 2
BCO ITAU SA	4.348,00	2,93	Faixa 2
BCO BRASIL SA	3.338,11	2,25	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	2.808,76	1,89	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.425,99	1,64	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	1.692,41	1,14	Faixa 1
BCO VOTORANTIM SA	1.316,89	0,89	Faixa 2
NATURA COSMETICOS SA	1.203,02	0,81	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.197,57	0,81	Faixa 1
VALE SA	1.031,09	0,70	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 PERFIL MODERADO

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	41.360	0,03%	Selic	05-out-20	0,11%	0,14%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	23.634	0,02%	Selic	20-out-20	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	29.502	0,02%	Selic	26-out-20	0,10%	0,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	502.181	0,34%	IPCA	09-out-20	2,03%	-2,33%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	34.969	0,02%	IPCA	06-out-20	0,23%	0,26%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	471.243	0,32%	IPCA	09-out-20	2,34%	2,25%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	54.571	0,04%	IPCA	09-out-20	4,30%	4,27%	ATLANTIDA FI MULT

