

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/09/2020

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	88.176.223,60	85,44%										
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,89%	2,02%	2,31%	3,60%	6,23%	12,57%	21,15%
Renda Fixa Total Return	88.176.223,60	85,44%			0,57%	-0,06%	0,75%	1,97%	1,10%	2,79%	14,23%	21,36%
ATLANTIDA FI MULT	45.946.839,73	44,52%	ITAU	44,90%	0,67%	0,02%	0,66%	1,71%	1,73%	3,68%	15,68%	23,41%
ITAPEMA FI MULT	42.229.383,87	40,92%	SUL AMERICA	42,71%	0,56%	-0,14%	0,86%	1,94%	0,06%	1,45%	12,29%	18,87%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,89%	2,02%	2,31%	3,60%	6,23%	12,57%	21,15%
Estruturado	15.029.888,73	14,56%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,28%	2,77%	4,57%	6,66%	16,75%	28,21%
Multimercado Estruturado	15.029.888,73	14,56%			0,98%	-0,70%	0,54%	2,43%	-0,08%	2,78%	11,36%	16,84%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	3.300.780,37	3,20%	ABSOLUTE	0,40%	0,47%	-0,10%	0,54%	0,97%	1,77%	4,24%	12,52%	23,90%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	1.230.385,91	1,19%	AZ QUEST	0,15%	1,34%	-0,82%	0,77%	3,02%	1,45%	4,79%	14,85%	22,46%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	1.036.767,50	1,00%	ITAU	0,02%	1,62%	-1,06%	1,06%	3,74%	0,72%	4,16%	18,22%	28,75%
KINEA CHRONOS FI MULT	9.461.954,95	9,17%	KINEA	0,13%	1,33%	-0,85%	0,44%	3,09%	-1,29%	1,83%	11,86%	19,99%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,28%	2,77%	4,57%	6,66%	16,75%	28,21%
Total	103.202.318,88	100%			0,61%	-0,16%	0,70%	1,90%	0,77%	2,55%	13,65%	20,32%
Benchmark:	IPCA + 3.15% a.a.					0,90%	2,06%	2,38%	3,72%	6,38%	12,90%	21,68%

* 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.

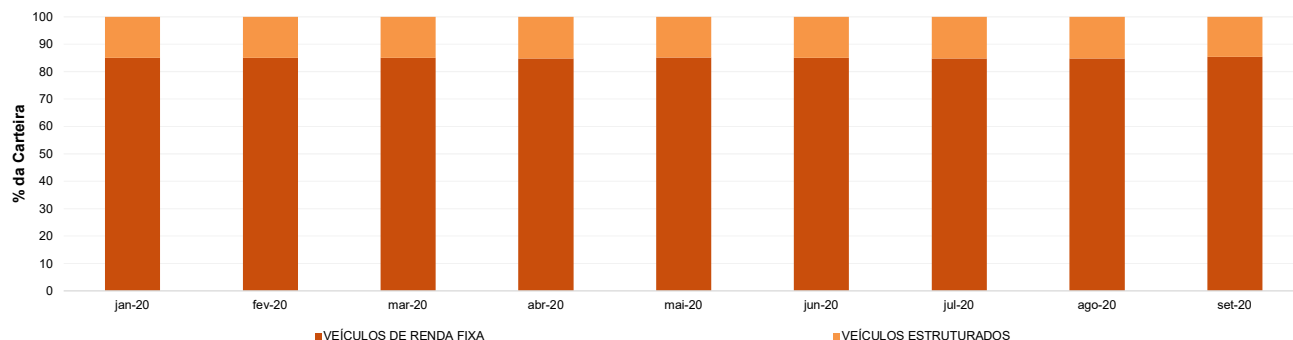
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

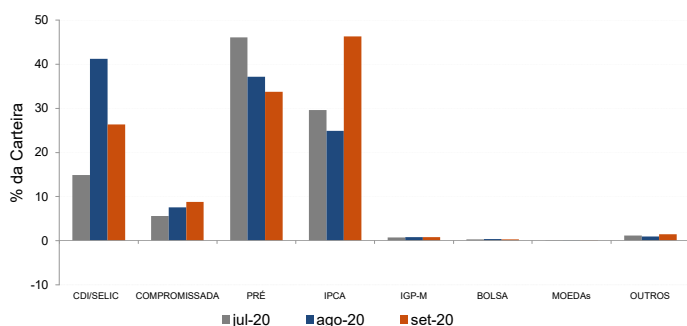
Distribuição da Carteira

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.

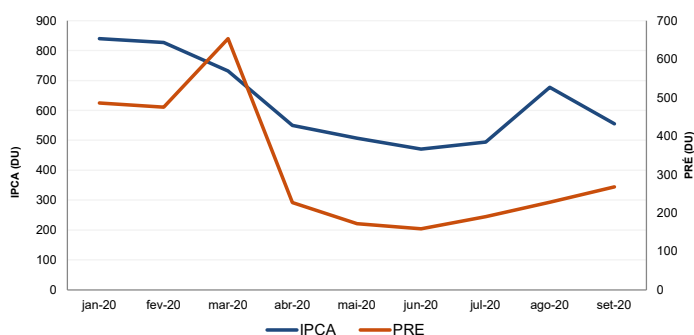
Evolução do Patrimônio Líquido



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	85,05	10,15	123,85	13,23
LINX3	Programas e Serviços	75,90	9,06	60,95	6,51
BPAC11	Intermediários Financeiros	41,73	4,98	38,34	4,10
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	41,69	4,98	35,43	3,78
CRFB3	Comércio e Distribuição	41,43	4,94	20,98	2,24
ALUP11	Energia Elétrica	39,38	4,70	37,89	4,05
FLRY3	Análises e Diagnósticos	39,10	4,67	0,18	0,02
JBSS3	Alimentos Processados	35,38	4,22	41,75	4,46
LCAM3	Diversos	33,60	4,01	6,34	0,68
MGLU3	Comércio	29,23	3,49	48,01	5,13

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

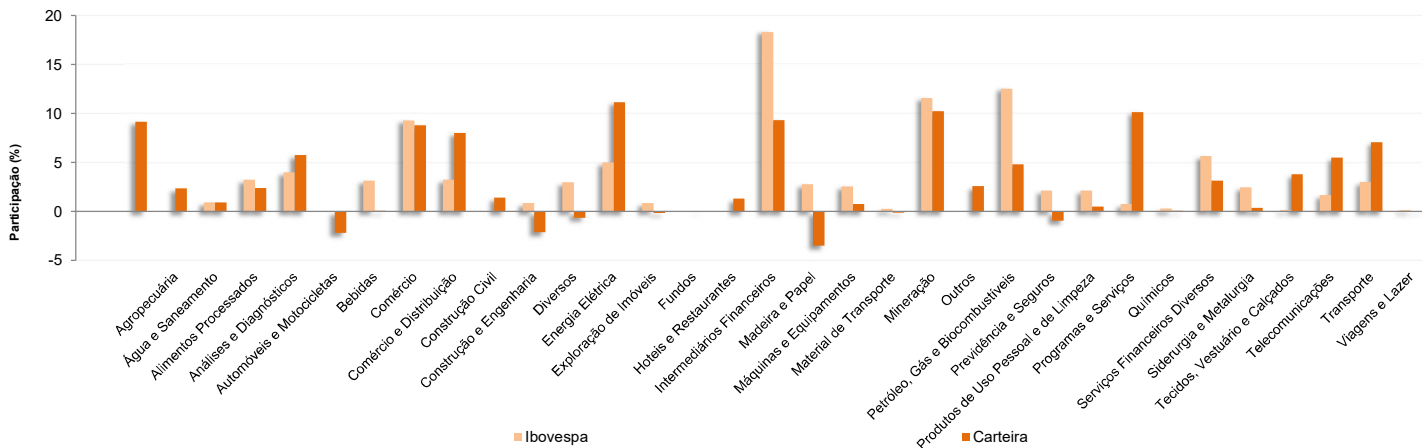
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	85,05	10,15	0,00	1
LINX3	75,90	9,06	0,00	1
BPAC11	41,73	4,98	0,00	1
PETR3	41,69	4,98	0,00	1
CRFB3	41,43	4,94	0,00	1
ALUP11	39,38	4,70	0,00	1
FLRY3	39,10	4,67	0,00	1
JBSS3	35,38	4,22	0,00	1
LCAM3	33,60	4,01	0,00	1
MGLU3	29,23	3,49	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.



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.

Análises de Contrapartes

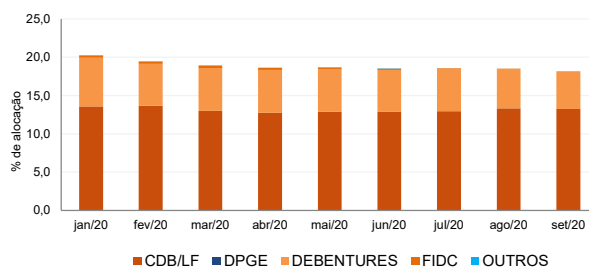
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.759,52	3,64	Faixa 2
BCO ITAU SA	3.670,23	3,55	Faixa 2
BCO BRASIL SA	2.457,16	2,38	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.976,70	1,91	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.350,74	1,31	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.283,17	1,24	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	972,53	0,94	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	612,75	0,59	Faixa 2
RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	420,66	0,41	Faixa 1
CCR SA	407,20	0,39	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: 30/09/2020

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	197.079	0,19%	Selic	18-set-20	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	249.826	0,24%	Selic	22-set-20	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	196.978	0,19%	Selic	11-set-20	0,03%	0,03%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	33.571	0,03%	Selic	16-set-20	5,00%	0,06%	ATLANTIDA FI MULT
LTN 2024-01-01	01-jan-24	3.847.345	3,72%	PRE	15-set-20	5,39%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	12.029.651	11,64%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	8.342.338	8,07%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	4.688.394	4,54%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	634.835	0,61%	IPCA	24-set-20	5,00%	-0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	317.418	0,31%	IPCA	18-set-20	0,20%	-0,08%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	317.418	0,31%	IPCA	21-set-20	0,19%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	317.418	0,31%	IPCA	21-set-20	7,00%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	317.418	0,31%	IPCA	21-set-20	0,20%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	215.232	0,21%	IPCA	21-set-20	0,10%	0,06%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	23.806	0,02%	IPCA	03-set-20	0,03%	-0,14%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	15.930	0,02%	IPCA	30-set-20	2,33%	2,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	3.540	0,00%	IPCA	22-set-20	2,19%	2,08%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	9.635	0,01%	IPCA	30-set-20	4,37%	4,30%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	7.708	0,01%	IPCA	22-set-20	4,37%	4,21%	ATLANTIDA FI MULT

