

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	113.045.239,48	76,12%										
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,89%	2,02%	2,31%	3,60%	6,23%	12,57%	21,15%
Renda Fixa Total Return	113.045.239,48	76,12%			0,57%	-0,06%	0,76%	1,82%	0,91%	2,57%	13,98%	20,97%
ATLANTIDA FI MULT	56.392.406,25	37,97%	ITAU	55,10%	0,67%	0,02%	0,66%	1,71%	1,73%	3,68%	15,68%	23,41%
ITAPEMA FI MULT	56.652.833,23	38,15%	SUL AMERICA	57,29%	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%
Renda Variável	17.647.595,96	11,88%										
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-4,56%	0,29%	31,49%	-16,37%	-6,97%	26,48%	39,08%
Renda Variável Ativa	17.647.595,96	11,88%			11,97%	-4,50%	2,30%	37,83%	-17,31%	-7,84%	33,56%	38,00%
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.987.230,61	2,01%	AZ QUEST	0,41%	12,52%	-6,19%	0,10%	33,91%	-17,68%	-10,03%	20,62%	34,83%
BRADESCO FIA SELECTION	2.955.123,36	1,99%	BRADESCO	0,43%	11,15%	-2,74%	5,81%	32,85%	-20,15%	-12,72%	15,23%	31,92%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	4.498.729,14	3,03%	BTG PACTUAL	0,18%	11,05%	-2,97%	4,71%	48,34%	-4,02%	5,55%	60,69%	61,87%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	3.860.904,20	2,60%	ITAU	0,25%	14,28%	-8,03%	-6,52%	24,90%	-33,17%	-23,46%	13,87%	19,15%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3.345.608,66	2,25%	NEO GESTAO	0,59%	11,21%	-2,25%	9,78%	49,52%	-10,34%	0,28%	51,35%	37,42%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-4,56%	0,29%	31,49%	-16,37%	-6,97%	26,48%	39,08%
Estruturado	17.824.792,03	12,00%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,40%	1,28%	2,77%	4,57%	6,66%	16,75%	28,21%
Multimercado Estruturado	17.824.792,03	12,00%			0,99%	-0,78%	0,58%	2,94%	0,44%	3,12%	11,75%	17,16%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	2.218.919,25	1,49%	ABSOLUTE	0,27%	0,47%	-0,10%	0,54%	0,97%	1,77%	4,24%	12,52%	23,90%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	2.908.142,00	1,96%	AZ QUEST	0,35%	1,34%	-0,82%	0,77%	3,02%	1,45%	4,79%	14,85%	22,46%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	2.565.064,22	1,73%	ITAU	0,05%	1,62%	-1,06%	1,06%	3,74%	0,72%	4,16%	18,22%	28,75%
KINEA CHRONOS FI MULT	10.132.666,57	6,82%	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	148.514.049,40	100%			1,85%	-0,70%	0,86%	5,02%	-1,57%	1,29%	16,00%	21,50%
Benchmark:	IPCA + 4.15% a.a.					0,98%	2,31%	2,88%	4,47%	7,42%	15,09%	25,23%

* 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 informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

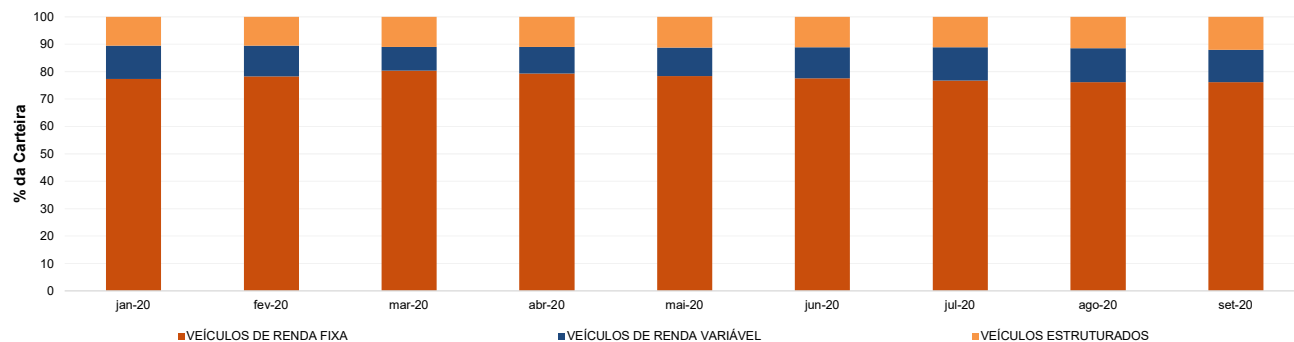
RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

Data-base: 30/09/2020

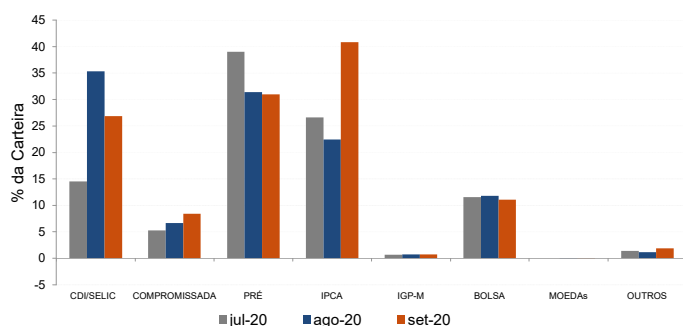
Distribuição da Carteira

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.

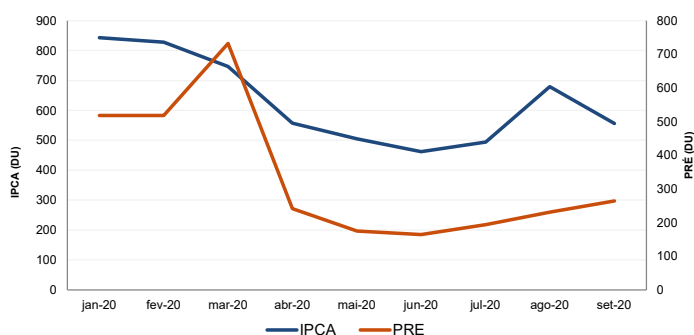
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



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*	%
MGLU3	Comércio	1.467,33	8,19	1.616,04	8,34
VALE3	Mineração	1.286,36	7,18	1.246,38	6,43
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	1.186,86	6,62	1.000,71	5,16
RENT3	Diversos	827,81	4,62	694,23	3,58
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	730,90	4,08	950,36	4,90
EQTL3	Energia Elétrica	614,68	3,43	656,34	3,39
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	580,90	3,24	542,15	2,80
BPAC11	Intermediários Financeiros	560,74	3,13	615,08	3,17
LREN3	Comércio	550,58	3,07	468,92	2,42
LINX3	Programas e Serviços	487,47	2,72	545,53	2,82

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

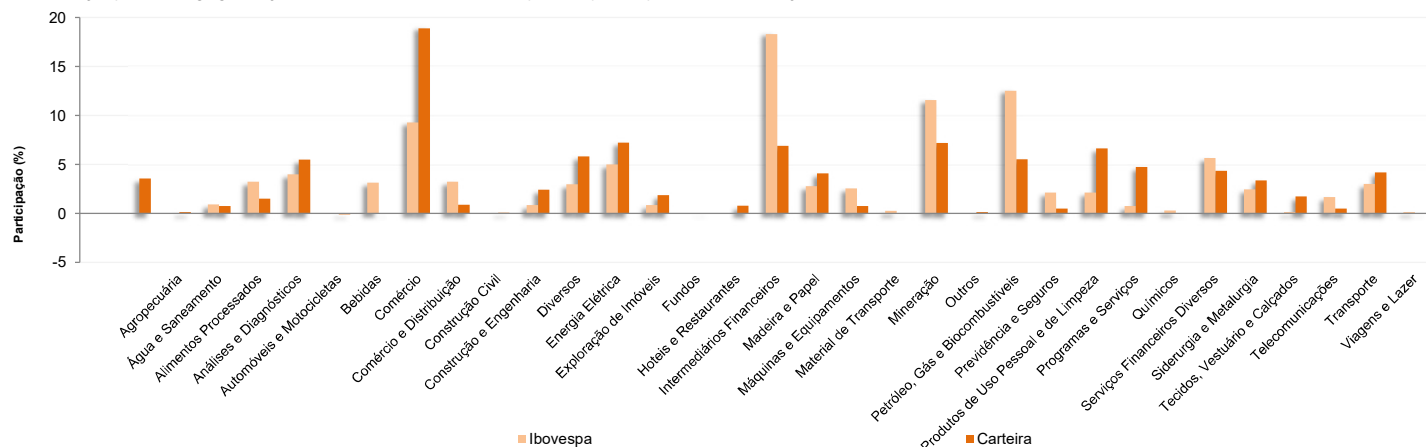
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MGLU3	1.467,33	8,19	0,00	1
VALE3	1.286,36	7,18	0,00	1
NTCO3	1.186,86	6,62	0,00	1
RENT3	827,81	4,62	0,00	1
B3SA3	730,90	4,08	0,00	1
EQTL3	614,68	3,43	0,00	1
GGBR4	580,90	3,24	0,00	1
BPAC11	560,74	3,13	0,00	1
LREN3	550,58	3,07	0,00	1
LINX3	487,47	2,72	0,01	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.



RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

Data-base: 30/09/2020

Análises de Contrapartes

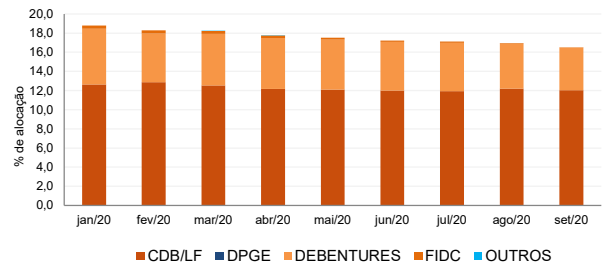
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	5.246,20	3,53	Faixa 2
BCO ITAU SA	4.842,90	3,26	Faixa 2
BCO BRASIL SA	3.395,87	2,28	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	2.694,08	1,81	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.426,08	1,63	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.721,44	1,16	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	1.467,33	0,99	Faixa 1
VALE SA	1.286,36	0,87	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.193,63	0,80	Faixa 1
NATURA COSMETICOS SA	1.186,86	0,80	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 cheçadas 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: 30/09/2020

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	241.882	0,16%	Selic	18-set-20	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	306.622	0,21%	Selic	22-set-20	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	241.760	0,16%	Selic	11-set-20	0,03%	0,03%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	41.203	0,03%	Selic	16-set-20	5,00%	0,06%	ATLANTIDA FI MULT
LTN 2024-01-01	01-jan-24	5.161.406	3,47%	PRE	15-set-20	5,39%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	14.764.475	9,93%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	10.238.887	6,89%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	5.754.254	3,87%	IPCA	10-set-20	0,12%	-0,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	851.663	0,57%	IPCA	24-set-20	5,00%	-0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	425.831	0,29%	IPCA	18-set-20	0,20%	-0,08%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	425.831	0,29%	IPCA	21-set-20	0,19%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	425.831	0,29%	IPCA	21-set-20	7,00%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	425.831	0,29%	IPCA	21-set-20	0,20%	0,06%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	264.163	0,18%	IPCA	21-set-20	0,10%	0,06%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	31.937	0,02%	IPCA	03-set-20	0,03%	-0,14%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	19.552	0,01%	IPCA	30-set-20	2,33%	2,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	4.345	0,00%	IPCA	22-set-20	2,19%	2,08%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	11.826	0,01%	IPCA	30-set-20	4,37%	4,30%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	9.461	0,01%	IPCA	22-set-20	4,37%	4,21%	ATLANTIDA FI MULT