

## RBSPREV - RBSPREV PGA

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>647.603,07</b>	<b>100%</b>			<b>-0,02%</b>	<b>0,34%</b>	<b>0,81%</b>	<b>1,65%</b>	<b>2,73%</b>	<b>8,41%</b>	<b>15,01%</b>	
Benchmark:	CDI				0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>647.603,07</b>	<b>100%</b>		<b>0,09%</b>								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	55.708,02	8,60%	BRADESCO	0,00%	0,14%	-0,03%	0,30%	0,99%	1,95%	3,17%	9,45%	16,54%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	591.895,06	91,41%	VOTORANTIM	0,34%	0,09%	-0,01%	0,38%	0,84%	1,75%	2,97%	9,48%	16,81%
Benchmark:	CDI				0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%	
<b>Total</b>	<b>647.542,84</b>	<b>100%</b>		<b>0,09%</b>	<b>-0,02%</b>	<b>0,34%</b>	<b>0,81%</b>	<b>1,65%</b>	<b>2,73%</b>	<b>8,41%</b>	<b>15,01%</b>	
Benchmark:	CDI				0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%	

\* 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.

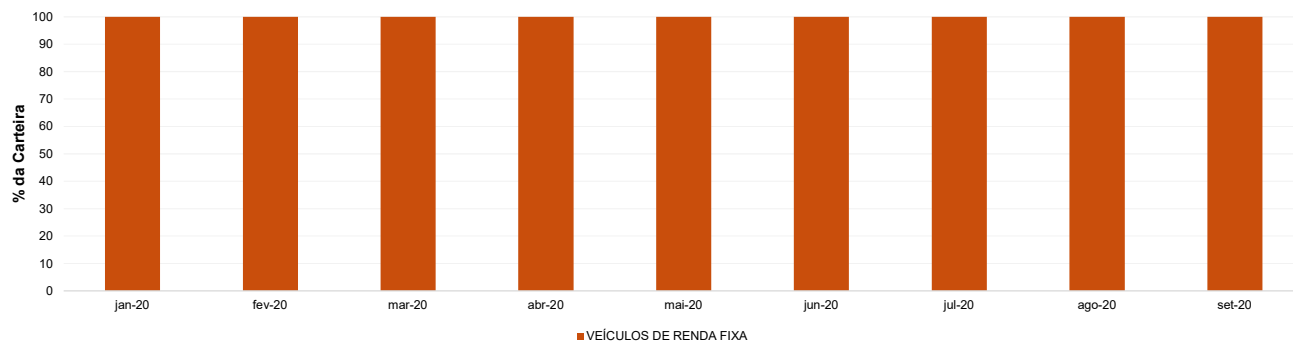
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

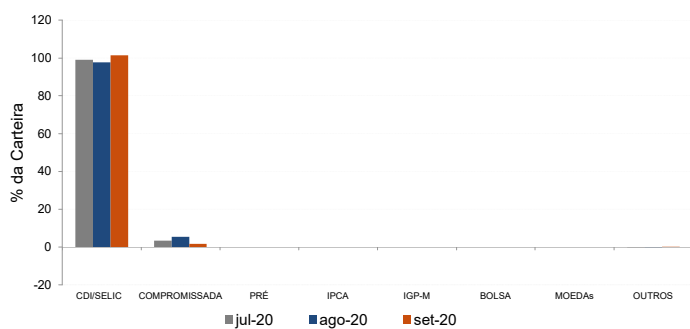
## Distribuição da Carteira

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.

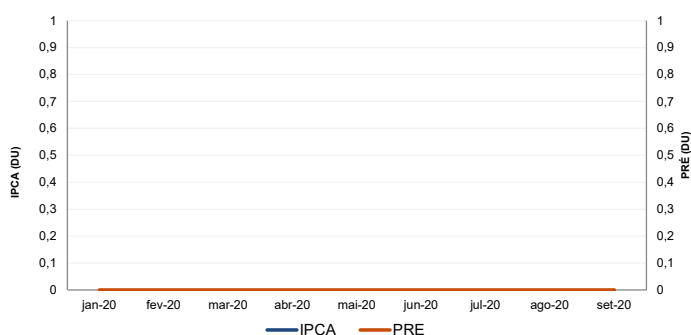
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/09/2020

## Análises de Contrapartes

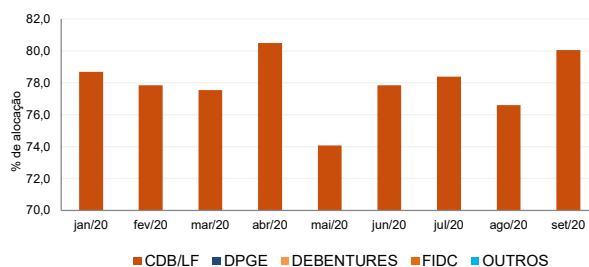
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO VOTORANTIM SA	70,59	10,91	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	61,37	9,48	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	43,47	6,72	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	40,77	6,30	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	40,17	6,21	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	37,55	5,80	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	35,93	5,55	Faixa 2
BCO ITAU SA	35,82	5,53	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	30,32	4,68	Faixa 2
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	24,40	3,77	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 PGA

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	05-set-22	17.181	2,65%	CDI	BCO BBM SA	04-set-20	1,00%	Faixa 1	BV BANKS RF CRED PRIV FI

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	506	0,08%	Selic		23-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	281	0,04%	Selic		03-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2	0,00%	Selic		01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		04-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1	0,00%	Selic		11-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		23-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		09-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		17-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		01-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		15-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		21-set-20	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	0	0,00%	Selic		08-set-20	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	578	0,09%	Selic		03-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	535	0,08%	Selic		23-set-20	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	361	0,06%	Selic		08-set-20	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	268	0,04%	Selic		28-set-20	7,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	268	0,04%	Selic		28-set-20	7,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	233	0,04%	Selic		28-set-20	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	134	0,02%	Selic		28-set-20	0,09%	0,09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	534	0,08%	Selic		23-set-20	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	320	0,05%	Selic		28-set-20	0,12%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	133	0,02%	Selic		23-set-20	0,10%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	665	0,10%	Selic		23-set-20	0,09%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	20.389	3,15%	Selic		09-set-20	0,03%	0,00%	BV BANKS RF CRED PRIV FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	14.620	2,26%	Selic		02-set-20	0,03%	0,00%	BV BANKS RF CRED PRIV FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	11.609	1,79%	Selic		28-set-20	0,14%	0,00%	BV BANKS RF CRED PRIV FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	794	0,12%	Selic		04-set-20	4,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	238	0,04%	Selic		10-set-20	4,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

