

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 26/02/2021

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	650.342,57	100%			0,16%	0,58%	0,83%	0,29%	1,95%	6,88%	12,85%	
Benchmark:	CDI				0,13%	0,45%	0,92%	0,28%	2,37%	8,09%	15,02%	
Renda Fixa CDI	650.342,57	100%		0,05%								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	53.060,16	8,16%	BRADESCO	0,00%	0,05%	0,09%	0,45%	0,64%	0,24%	1,99%	7,48%	14,16%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	597.282,41	91,85%	VOTORANTIM	0,45%	0,05%	0,18%	0,62%	0,90%	0,31%	1,97%	7,67%	14,58%
Benchmark:	CDI				0,13%	0,45%	0,92%	0,28%	2,37%	8,09%	15,02%	
Total	650.292,22	100%		0,05%	0,16%	0,58%	0,83%	0,29%	1,95%	6,88%	12,85%	
Benchmark:	CDI				0,13%	0,45%	0,92%	0,28%	2,37%	8,09%	15,02%	

* 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.

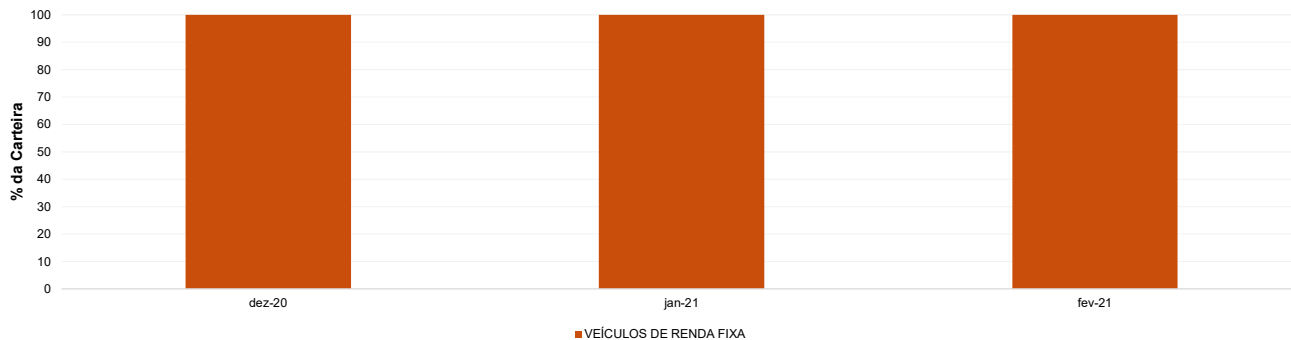
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

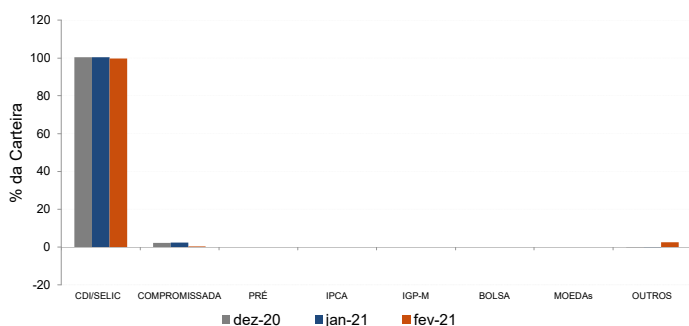
Distribuição da Carteira

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.

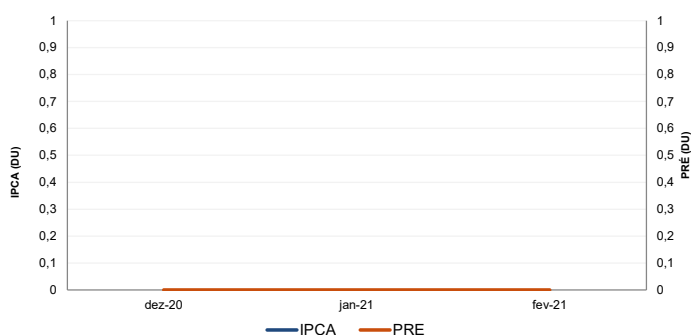
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 26/02/2021

Análises de Contrapartes

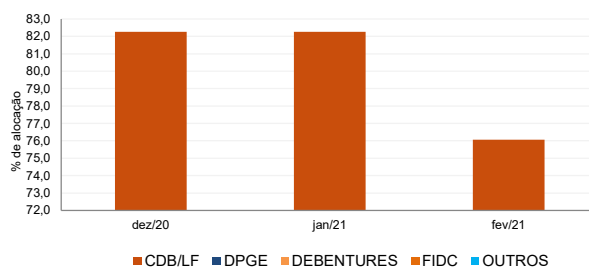
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO VOTORANTIM SA	81,42	12,53	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	57,04	8,78	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	53,49	8,23	Faixa 1
BCO ITAU SA	46,99	7,23	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	40,39	6,22	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	39,78	6,12	Faixa 2
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	32,01	4,93	Faixa 1
BCO SAFRA SA	28,59	4,40	Faixa 2
BCO BBM SA	22,36	3,44	Faixa 1
BCO JOHN DEERE SA	20,25	3,12	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: 26/02/2021

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 2022-03-01	01-mar-22	2.954	0,45%	Selic	11-fev-21	0,12%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	802	0,12%	Selic	04-fev-21	0,12%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	40.177	6,19%	Selic	22-fev-21	34,61%	0,22%	BV BANKS RF CRED PRIV FI

