

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/01/2021

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	649.305,32	100%			0,13%	0,61%	0,82%	0,13%	2,08%	7,18%	13,17%	
Benchmark:	CDI				0,15%	0,46%	0,94%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%	
Renda Fixa CDI	649.305,32	100%		0,05%								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	53.069,83	8,17%	BRADESCO	0,00%	0,05%	0,15%	0,47%	0,70%	0,15%	2,18%	7,90%	14,57%
BV BANKS RF CRED PRIV FI	596.235,48	91,83%	VOTORANTIM	0,45%	0,05%	0,14%	0,65%	0,90%	0,14%	2,10%	8,02%	14,90%
Benchmark:	CDI				0,15%	0,46%	0,94%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%	
Total	649.249,82	100%		0,05%	0,13%	0,61%	0,82%	0,13%	2,08%	7,18%	13,17%	
Benchmark:	CDI				0,15%	0,46%	0,94%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%	

* 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.

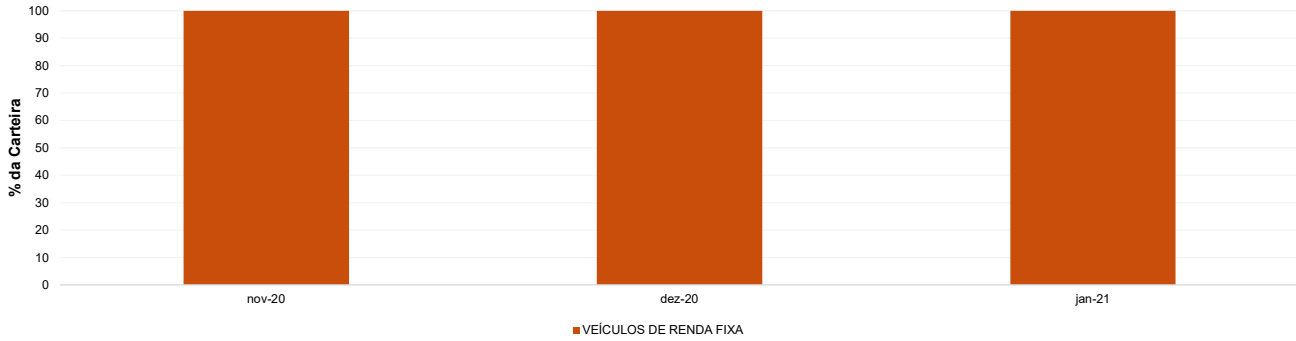
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/01/2021

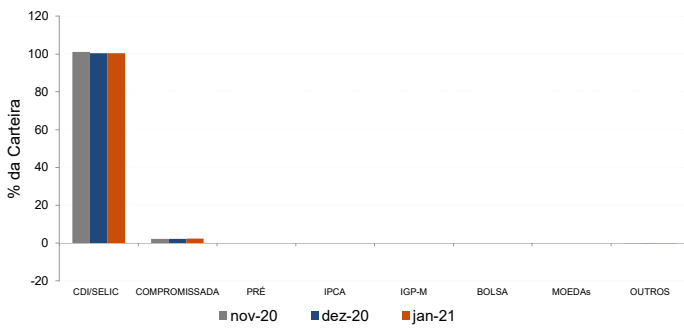
Distribuição da Carteira

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.

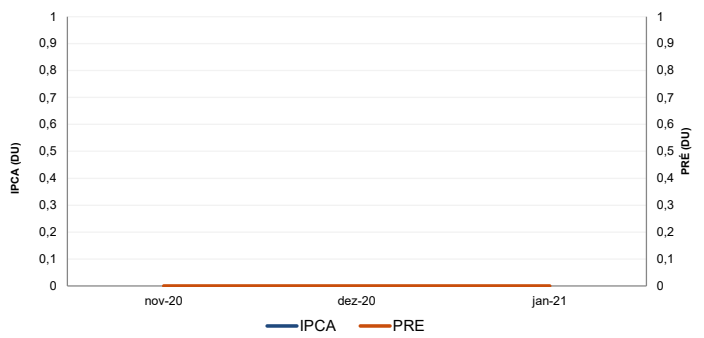
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/01/2021

Análises de Contrapartes

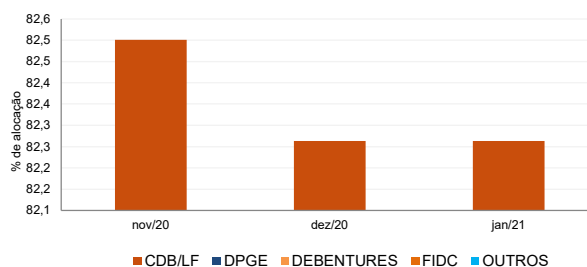
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO VOTORANTIM SA	84,93	13,09	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	56,96	8,78	Faixa 1
BCO CNH CAPITAL SA	53,42	8,23	Faixa 1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	52,64	8,11	Faixa 1
BCO ITAU SA	46,93	7,23	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	40,30	6,21	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	39,73	6,12	Faixa 2
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	31,97	4,93	Faixa 1
BCO SAFRA SA	28,60	4,41	Faixa 2
BCO BBM SA	22,37	3,45	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: 29/01/2021

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 2021-03-01	01-mar-21	508	0,08%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	342	0,05%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	171	0,03%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	85	0,01%	Selic	14-jan-21	0,08%	0,07%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	256	0,04%	Selic	14-jan-21	0,09%	0,09%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	85	0,01%	Selic	13-jan-21	0,09%	0,09%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	47	0,01%	Selic	13-jan-21	0,09%	0,09%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	171	0,03%	Selic	14-jan-21	0,10%	0,11%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	26	0,00%	Selic	13-jan-21	0,10%	0,10%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	171	0,03%	Selic	14-jan-21	0,10%	0,10%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	85	0,01%	Selic	14-jan-21	0,10%	0,10%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	256	0,04%	Selic	14-jan-21	0,10%	0,10%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

