

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2019

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 | 6.691.575,78 | 100% | | | 0,55% | 1,80% | 3,88% | 7,78% | 8,83% | 20,64% | 32,43% |
| Benchmark: | IPCA + 4% a.a. | | | | 0,46% | 1,20% | 2,56% | 6,04% | 6,64% | 15,92% | 23,79% |
| Renda Fixa ALM | 6.009.204,49 | 89,83% | | | | | | | | | |
| RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC | 6.009.204,49 | 89,83% | 100% | | 0,59% | 1,93% | 4,19% | 8,48% | 9,60% | 22,06% | 35,18% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | 0,49% | 1,30% | 2,75% | 6,37% | 7,04% | 16,79% | 25,19% |
| Renda Fixa CDI | 682.371,29 | 10,20% | | 0,00% | | | | | | | |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II | 682.371,29 | 10,20% | BRADESCO | 0,00% | 0,00% | 0,48% | 1,45% | 3,05% | 5,13% | 6,16% | 13,06% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,48% | 1,46% | 3,07% | 5,17% | 6,21% | 13,17% | 25,74% |
| Total | 6.689.667,31 | 100% | | 0,00% | 0,55% | 1,80% | 3,88% | 7,78% | 8,83% | 20,64% | 32,43% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | 0,49% | 1,30% | 2,75% | 6,37% | 7,04% | 16,79% | 25,19% |

* As rentabilidades dos fundos de investimentos foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

- O valor Total apresentado é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

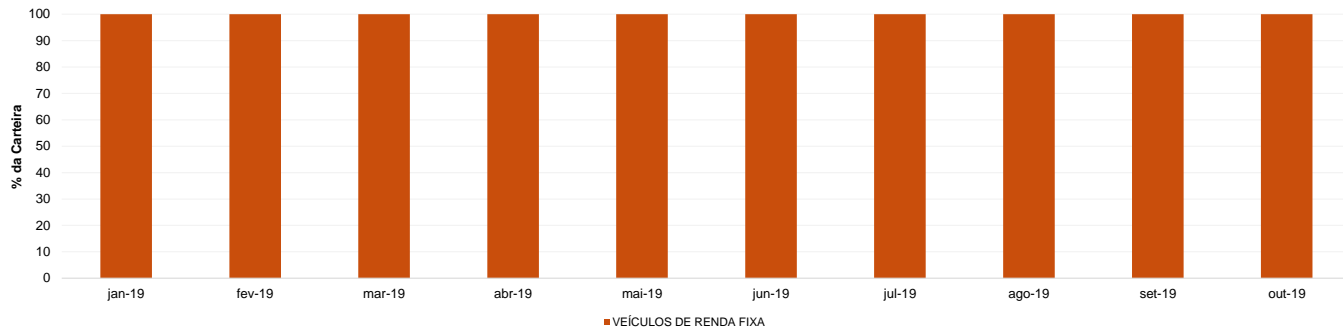
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

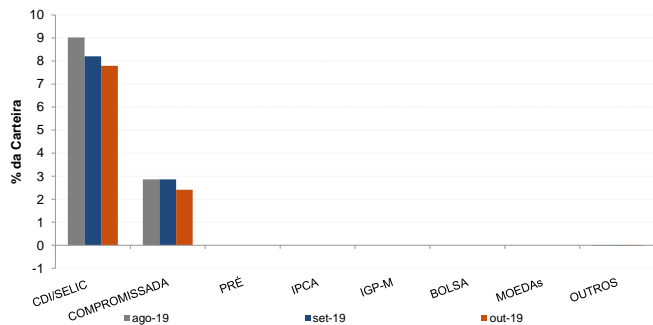
Distribuição da Carteira

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.

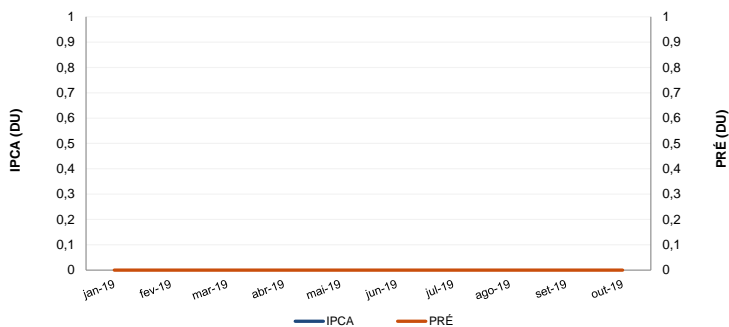
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2019

Análises de Contrapartes

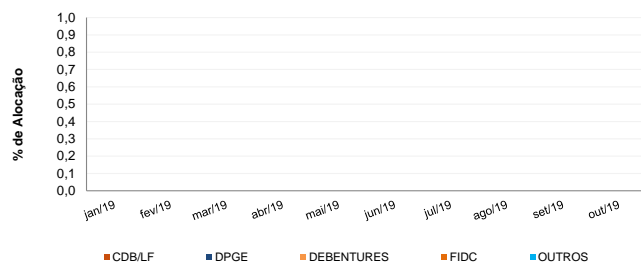
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|------|------|---|-------|---------|-----|
|------|------|---|-------|---------|-----|

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Rating 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 o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

| Títulos Privados | Valor (mil R\$) | Contraparte | Anterior | Atual | Agência | Venc. | Index. | Taxa | Veículo |
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|
|------------------|-----------------|-------------|----------|-------|---------|-------|--------|------|---------|

Nenhuma mudança de rating encontrada.

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base:

31/10/2019

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.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota 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 | 3.491 | 0,05% | Selic | 31-out-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 2.182 | 0,03% | Selic | 28-out-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 1.309 | 0,02% | Selic | 30-out-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 436 | 0,01% | Selic | 03-out-19 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 524 | 0,01% | Selic | 03-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 1.265 | 0,02% | Selic | 02-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 2.617 | 0,04% | Selic | 31-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 436 | 0,01% | Selic | 04-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 436 | 0,01% | Selic | 04-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 1.308 | 0,02% | Selic | 04-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 2.617 | 0,04% | Selic | 31-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 436 | 0,01% | Selic | 04-out-19 | 0,01% | 0,01% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 2.180 | 0,03% | Selic | 31-out-19 | 0,02% | 0,02% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 5.691 | 0,09% | Selic | 18-out-19 | 0,02% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 5.691 | 0,09% | Selic | 18-out-19 | 0,02% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 744 | 0,01% | Selic | 18-out-19 | 0,02% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |