

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/04/2020

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.409.601,20</b>	<b>100%</b>			<b>0,42%</b>	<b>1,77%</b>	<b>5,11%</b>	<b>3,05%</b>	<b>9,18%</b>	<b>21,07%</b>	<b>32,38%</b>	
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.				-0,08%	0,72%	3,37%	1,19%	5,48%	13,99%	20,62%	
<b>Renda Fixa ALM</b>	<b>6.146.001,07</b>	<b>95,91%</b>										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.146.001,07	95,91%		100%	0,43%	1,84%	5,50%	3,24%	9,92%	22,70%	36,04%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,03%	1,04%	4,05%	1,63%	6,91%	17,08%	25,55%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>263.600,13</b>	<b>4,11%</b>		<b>0,01%</b>								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	263.600,13	4,11%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,27%	0,88%	2,02%	1,26%	5,12%	11,74%	20,88%
Benchmark:	CDI				0,28%	0,92%	2,07%	1,30%	5,20%	11,88%	20,96%	
<b>Total</b>	<b>6.408.317,88</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>	<b>0,42%</b>	<b>1,77%</b>	<b>5,11%</b>	<b>3,05%</b>	<b>9,18%</b>	<b>21,07%</b>	<b>32,38%</b>
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,03%	1,04%	4,05%	1,63%	6,91%	17,08%	25,55%	

\* 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.

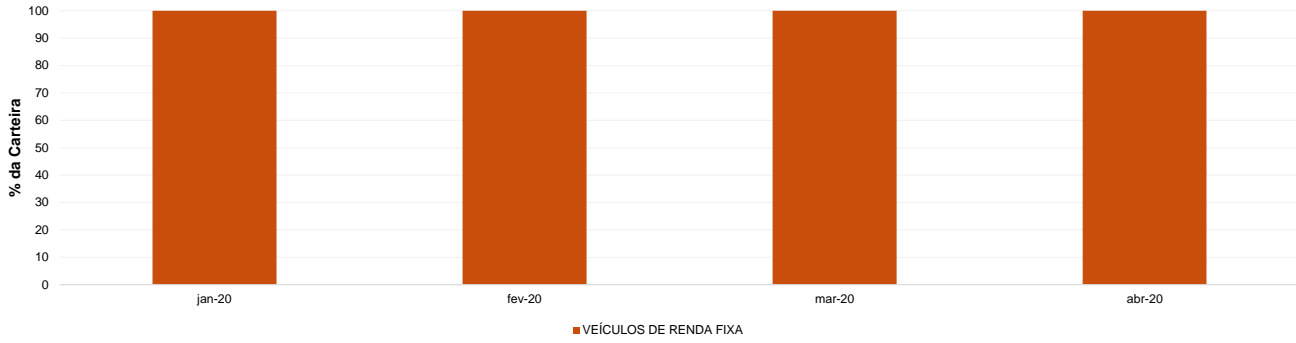
RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/04/2020

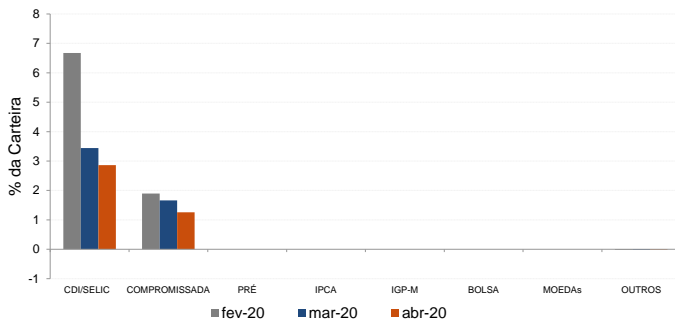
## Distribuição da Carteira

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.

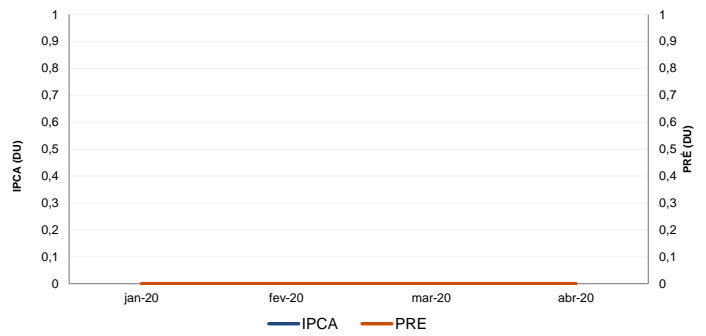
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/04/2020

## Análises de Contrapartes

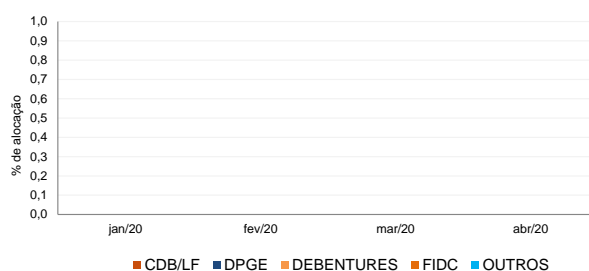
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
------	------	---	---------------------------

\* 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 CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/04/2020

## 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	1.388	0,02%	Selic	28-abr-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	791	0,01%	Selic	28-abr-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	194	0,00%	Selic	29-abr-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.165	0,07%	Selic	27-abr-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II