

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2020

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
Renda Fixa	6.293.130,49	100%				0,76%	2,21%	3,57%	5,43%	8,74%	18,90%	31,56%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,49%	1,63%	1,74%	2,69%	5,51%	12,36%	20,56%
Renda Fixa ALM	5.728.793,80	91,05%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.728.793,80	91,05%		100%		0,82%	2,29%	3,68%	5,71%	9,32%	20,42%	33,78%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,60%	1,99%	2,43%	3,61%	6,94%	15,40%	25,47%
Renda Fixa CDI	564.336,69	8,97%			0,01%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	564.336,69	8,97%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,16%	0,56%	1,40%	2,06%	3,80%	10,27%	17,77%
Benchmark:	CDI					0,16%	0,57%	1,44%	2,12%	3,88%	10,40%	17,95%
Total	6.291.819,53	100%			0,00%	0,76%	2,21%	3,57%	5,43%	8,74%	18,90%	31,56%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,60%	1,99%	2,43%	3,61%	6,94%	15,40%	25,47%

* 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.

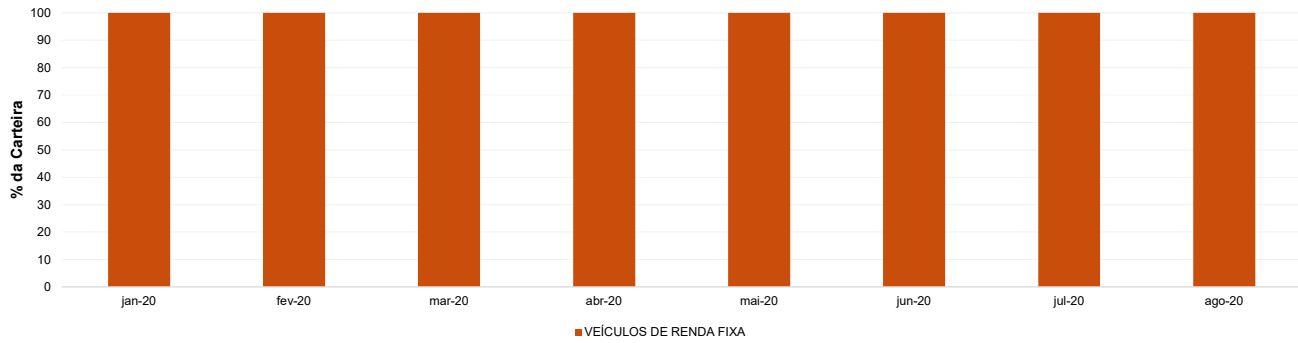
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

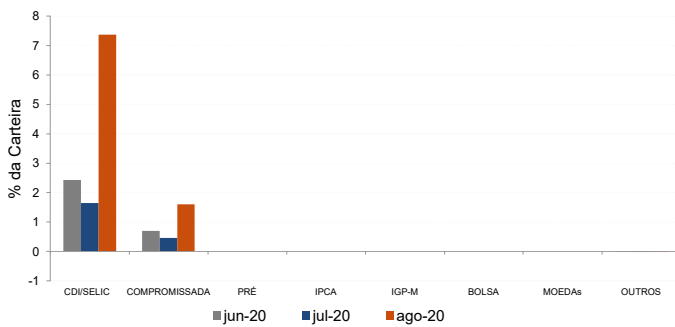
Distribuição da Carteira

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.

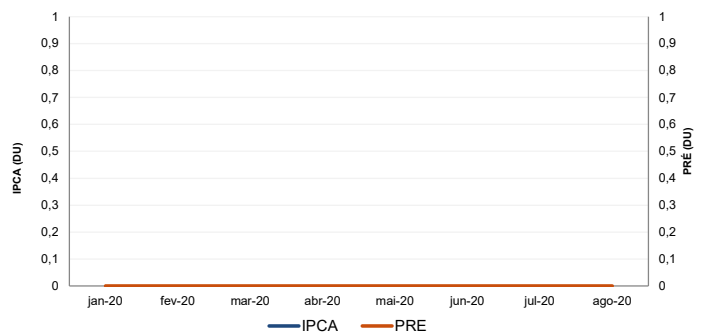
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2020

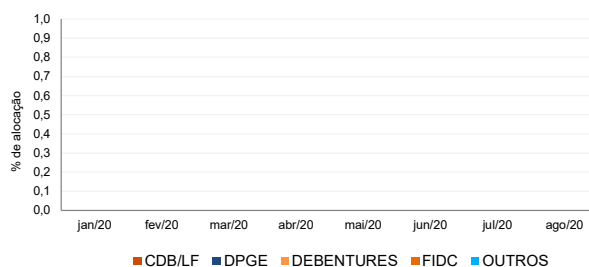
Análises de Contrapartes

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

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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: 31/08/2020

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	4.323	0,07%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	7.410	0,12%	Selic	03-ago-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	12.346	0,20%	Selic	14-ago-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	617	0,01%	Selic	03-ago-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.110	0,02%	Selic	03-ago-20	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

