

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2020

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	6.281.966,90	100%			1,63%	4,17%	6,78%	10,62%	10,62%	21,60%	34,06%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.				1,61%	3,90%	5,99%	7,64%	7,64%	15,66%	23,56%
Renda Fixa ALM	5.976.541,24	95,16%									
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.976.541,24	95,16%		100%	1,74%	4,50%	7,33%	11,50%	11,50%	23,60%	36,85%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,73%	4,25%	6,72%	9,09%	9,09%	18,80%	28,62%
Renda Fixa CDI	305.425,66	4,86%		0,12%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	305.425,66	4,86%	BRADESCO	0,00%	0,12%	0,22%	0,45%	0,79%	2,52%	2,52%	8,58%
Benchmark:	CDI				0,16%	0,47%	0,99%	2,77%	2,77%	8,90%	15,90%
Total	6.280.604,43	100%			0,01%	1,63%	4,17%	6,78%	10,62%	10,62%	21,60%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,73%	4,25%	6,72%	9,09%	9,09%	18,80%	28,62%

* 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.

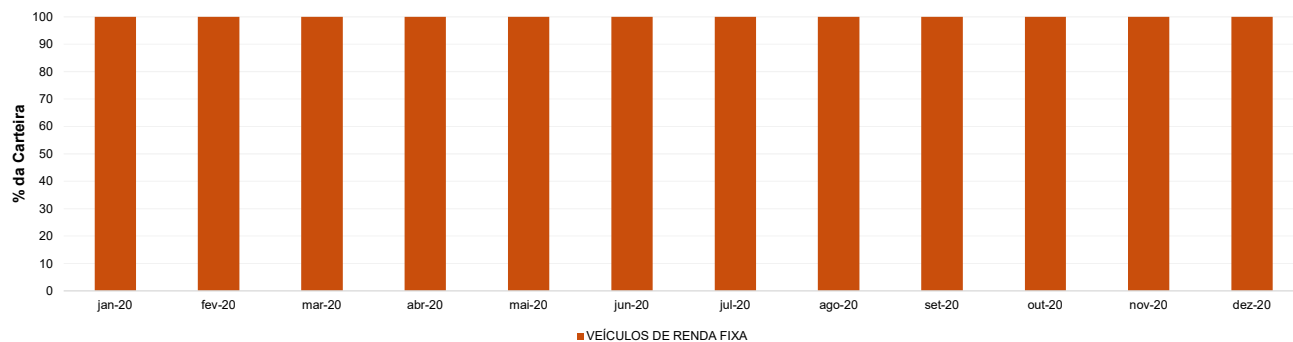
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

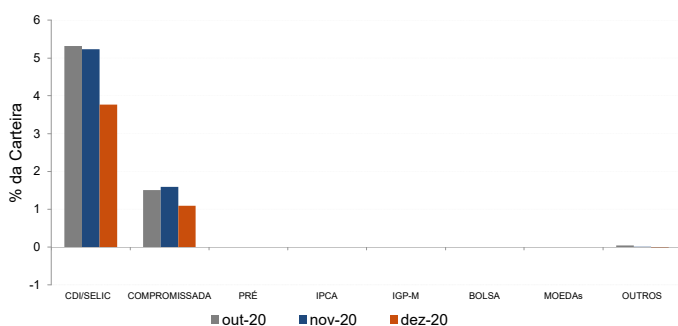
Distribuição da Carteira

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.

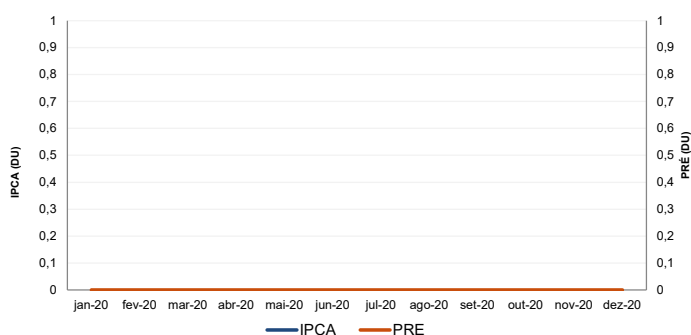
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2020

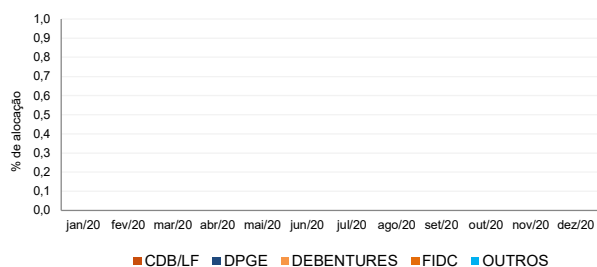
Análises de Contrapartes

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: 31/12/2020

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 2021-09-01	01-set-21	2.946	0,05%	Selic	11-dez-20	7,00%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	316	0,01%	Selic	14-dez-20	7,00%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.401	0,02%	Selic	08-dez-20	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.750	0,03%	Selic	10-dez-20	0,14%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	752	0,01%	Selic	10-dez-20	0,15%	0,15%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	17	0,00%	Selic	01-dez-20	0,22%	0,22%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

