

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2020

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	6.638.065,59	100%			0,53%	3,10%	5,00%	1,80%	10,19%	21,29%	32,89%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,56%	2,68%	4,40%	1,15%	8,55%	17,73%	26,33%	
Renda Fixa ALM	6.069.342,29	91,45%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.069.342,29	91,45%		100%	0,57%	3,38%	5,44%	1,95%	11,13%	22,91%	36,58%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,56%	2,68%	4,40%	1,15%	8,55%	17,73%	26,33%	
Renda Fixa CDI	568.723,30	8,57%		0,01%								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	568.723,30	8,57%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,28%	1,03%	2,36%	0,65%	5,52%	12,23%	22,38%
Benchmark:	CDI				0,29%	1,05%	2,40%	0,67%	5,58%	12,35%	22,43%	
Total	6.636.494,48	100%			0,00%	0,53%	3,10%	5,00%	1,80%	10,19%	21,29%	32,89%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,56%	2,68%	4,40%	1,15%	8,55%	17,73%	26,33%	

* 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.

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

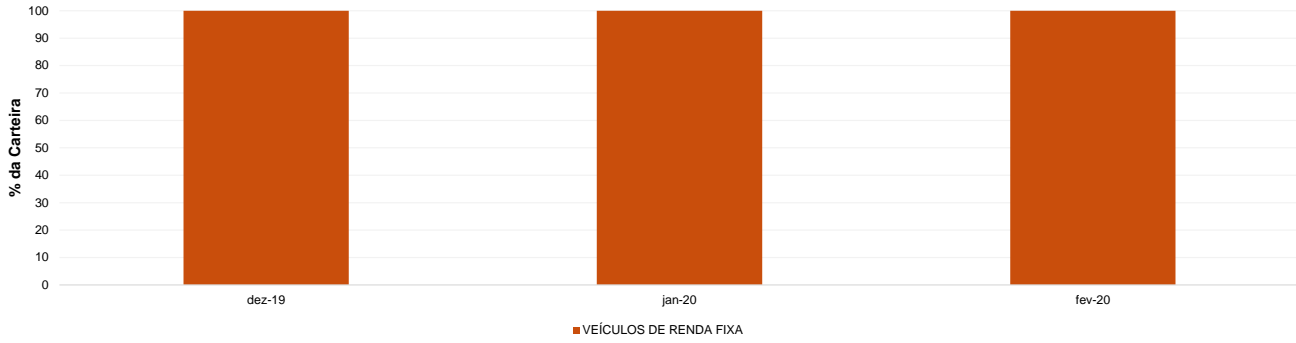
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

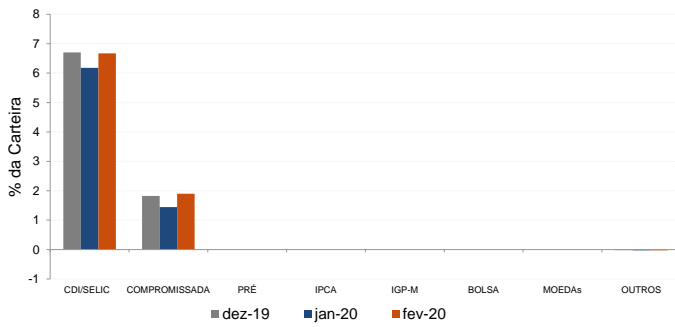
Distribuição da Carteira

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.

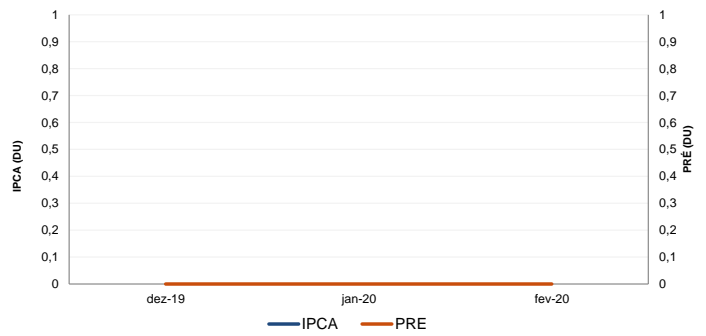
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2020

Análises de Contrapartes

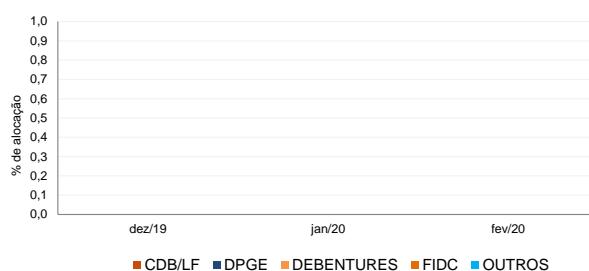
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 28/02/2020

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	3.865	0,06%	Selic	27-fev-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	5.648	0,09%	Selic	28-fev-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.675	0,04%	Selic	28-fev-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

