

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2020

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	6.309.443,12	100%			0,91%	1,53%	3,33%	4,63%	8,64%	18,88%	31,82%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.				0,63%	0,99%	1,72%	2,19%	5,39%	12,02%	20,53%
Renda Fixa ALM	6.177.013,88	97,92%									
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.177.013,88	97,92%	100%		0,91%	1,54%	3,41%	4,83%	9,19%	20,35%	34,01%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,75%	1,34%	2,39%	2,99%	6,82%	15,06%	25,45%
Renda Fixa CDI	132.429,24	2,10%		0,02%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	132.429,24	2,10%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,19%	0,64%	1,53%	1,90%	4,15%	10,72%
Benchmark:	CDI				0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%
Total	6.308.004,96	100%		0,00%	0,92%	1,55%	3,34%	4,65%	8,66%	18,90%	31,84%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,75%	1,34%	2,39%	2,99%	6,82%	15,06%	25,45%

* 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.

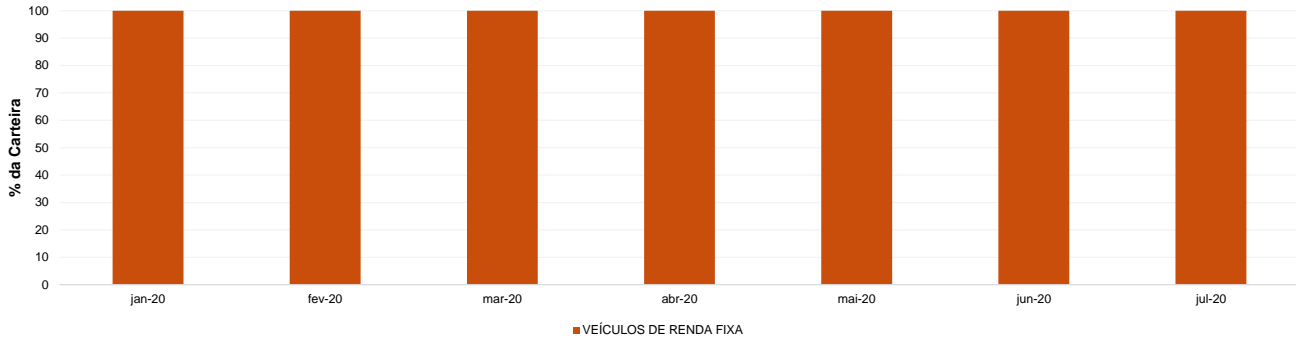
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

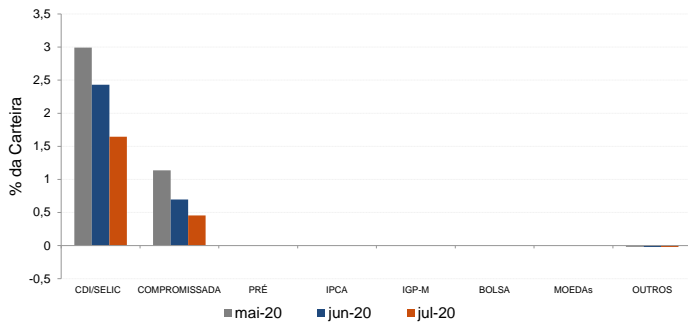
Distribuição da Carteira

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.

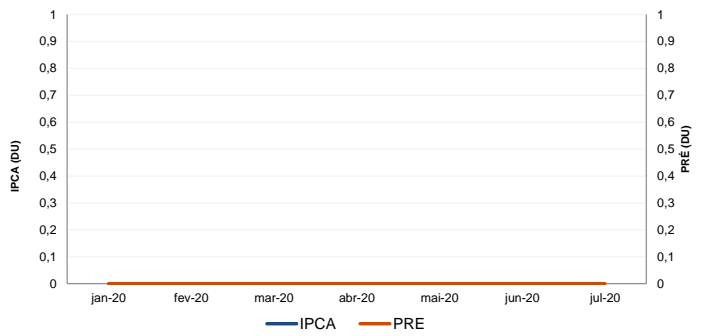
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2020

Análises de Contrapartes

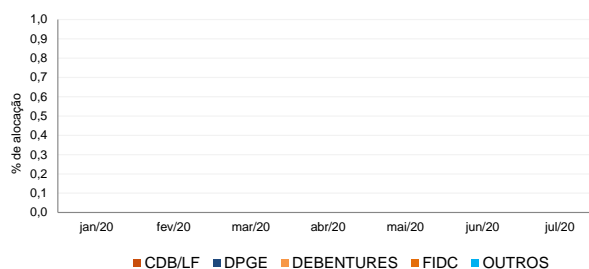
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/07/2020

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	265	0,00%	Selic	14-jul-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	210	0,00%	Selic	30-jul-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	56	0,00%	Selic	30-jul-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.794	0,04%	Selic	27-jul-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.794	0,04%	Selic	29-jul-20	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.263	0,02%	Selic	29-jul-20	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	699	0,01%	Selic	29-jul-20	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	699	0,01%	Selic	29-jul-20	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	629	0,01%	Selic	30-jul-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	134	0,00%	Selic	29-jul-20	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.276	0,04%	Selic	03-jul-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.396	0,02%	Selic	20-jul-20	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.241	0,02%	Selic	09-jul-20	4,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	1.136	0,02%	Selic	03-jul-20	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II