

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2020

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	6.318.036,14	100%				0,52%	1,05%	3,69%	3,69%	8,41%	19,37%	31,24%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,51%	0,28%	1,55%	1,55%	5,21%	11,97%	20,35%
Renda Fixa ALM	6.120.492,31	96,89%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.120.492,31	96,89%		100%		0,53%	1,06%	3,89%	3,89%	9,01%	20,83%	33,39%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,62%	0,61%	2,22%	2,22%	6,63%	15,00%	25,26%
Renda Fixa CDI	197.543,83	3,13%			0,02%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	197.543,83	3,13%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,21%	0,72%	1,71%	1,71%	4,54%	11,10%	19,26%
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%
Total	6.316.718,28	100%			0,00%	0,52%	1,05%	3,69%	3,69%	8,41%	19,37%	31,24%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,62%	0,61%	2,22%	2,22%	6,63%	15,00%	25,26%

* 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.

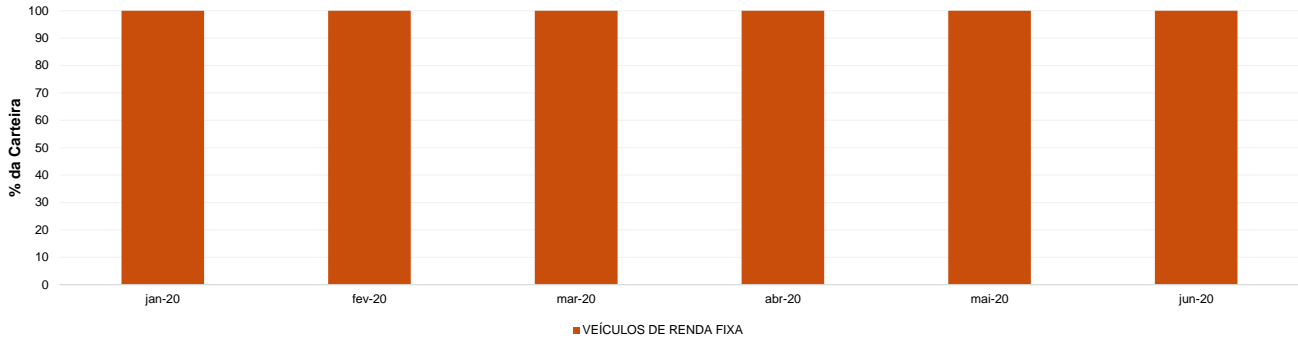
RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2020

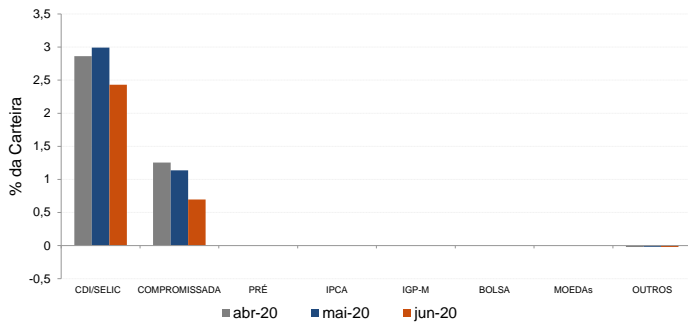
Distribuição da Carteira

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.

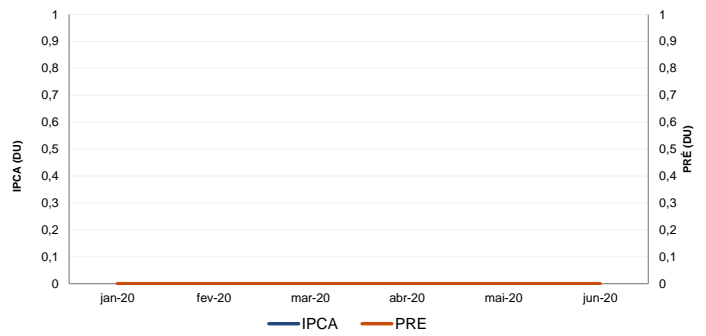
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2020

Análises de Contrapartes

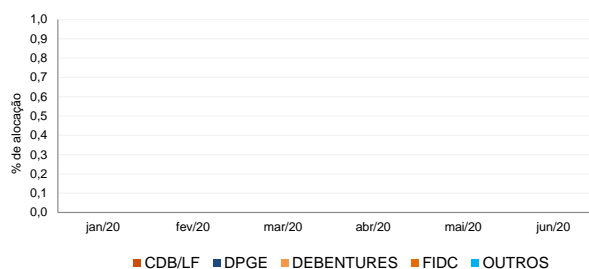
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 30/06/2020

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	4.207	0,07%	Selic	24-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.104	0,03%	Selic	18-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.557	0,02%	Selic	01-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	547	0,01%	Selic	24-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	421	0,01%	Selic	23-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	316	0,00%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	252	0,00%	Selic	05-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	210	0,00%	Selic	18-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.169	0,02%	Selic	02-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.052	0,02%	Selic	18-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	694	0,01%	Selic	02-jun-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.156	0,02%	Selic	01-jun-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II