

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/05/2020

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	6.350.479,64	100%			0,10%	1,33%	4,47%	3,15%	8,33%	20,34%	31,32%	
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.				-0,15%	0,11%	2,45%	1,04%	4,92%	13,09%	19,77%	
Renda Fixa ALM	6.088.201,59	95,89%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.088.201,59	95,89%		100%	0,09%	1,36%	4,79%	3,34%	8,97%	21,91%	34,92%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				-0,04%	0,44%	3,13%	1,59%	6,33%	16,15%	24,65%	
Renda Fixa CDI	262.278,05	4,13%		0,01%								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	262.278,05	4,13%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,23%	0,84%	1,87%	1,50%	4,81%	11,44%	20,04%
Benchmark:	CDI				0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	
Total	6.349.213,32	100%			0,00%	0,10%	1,33%	4,47%	3,15%	8,33%	20,34%	31,32%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				-0,04%	0,44%	3,13%	1,59%	6,33%	16,15%	24,65%	

* 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.

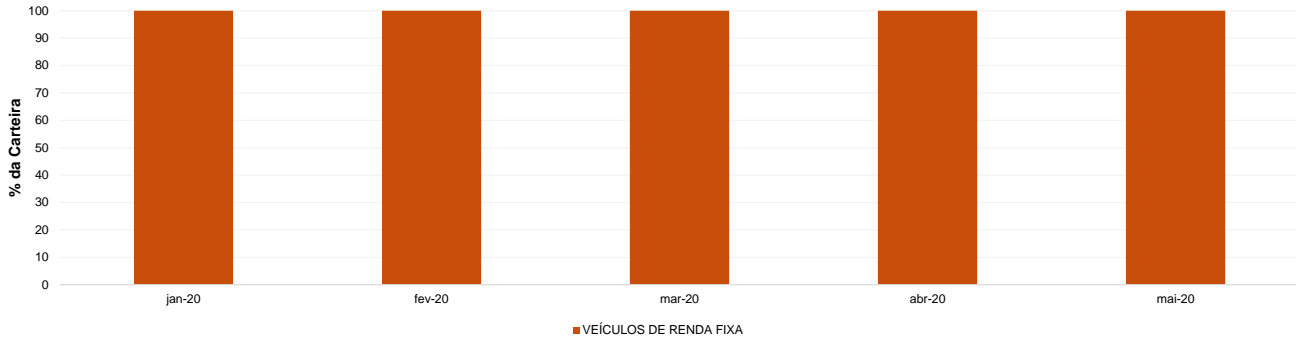
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

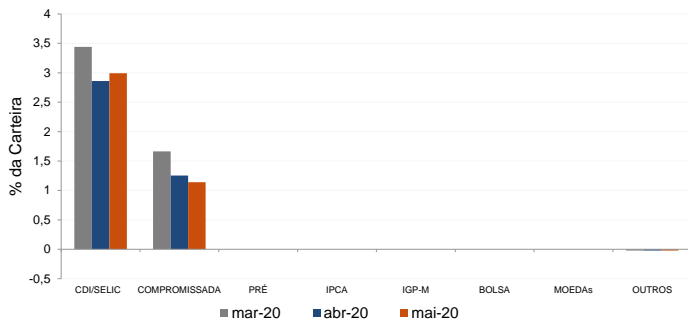
Distribuição da Carteira

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.

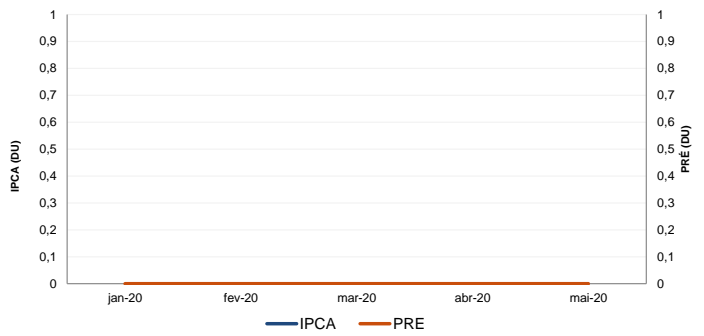
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/05/2020

Análises de Contrapartes

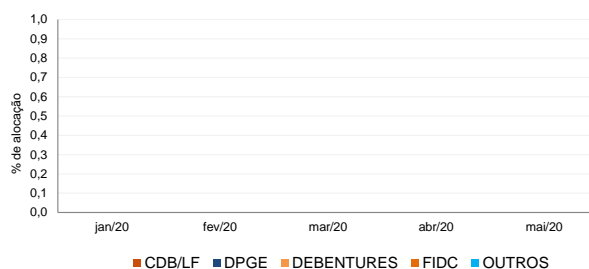
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/05/2020

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	2.852	0,04%	Selic	29-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.256	0,04%	Selic	20-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.115	0,03%	Selic	20-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.820	0,04%	Selic	15-mai-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.819	0,04%	Selic	15-mai-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.255	0,04%	Selic	21-mai-20	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II