

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2020

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	6.448.628,34	100,02%				0,80%	2,61%	5,24%	2,61%	10,04%	21,36%	32,74%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,33%	1,26%	3,83%	1,26%	6,43%	14,61%	21,14%
Renda Fixa ALM	6.119.596,70	94,92%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.119.596,70	94,92%		100%		0,83%	2,80%	5,67%	2,80%	10,90%	23,01%	36,43%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,45%	1,60%	4,53%	1,60%	7,87%	17,72%	26,08%
Renda Fixa CDI	329.031,64	5,10%			0,02%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	329.031,64	5,10%	BRADESCO	0,00%	0,02%	0,33%	0,98%	2,23%	0,98%	5,38%	12,01%	21,51%
Benchmark:	CDI					0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%
Total	6.447.194,30	100%			0,00%	0,80%	2,61%	5,24%	2,61%	10,04%	21,36%	32,74%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,45%	1,60%	4,53%	1,60%	7,87%	17,72%	26,08%

* 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.

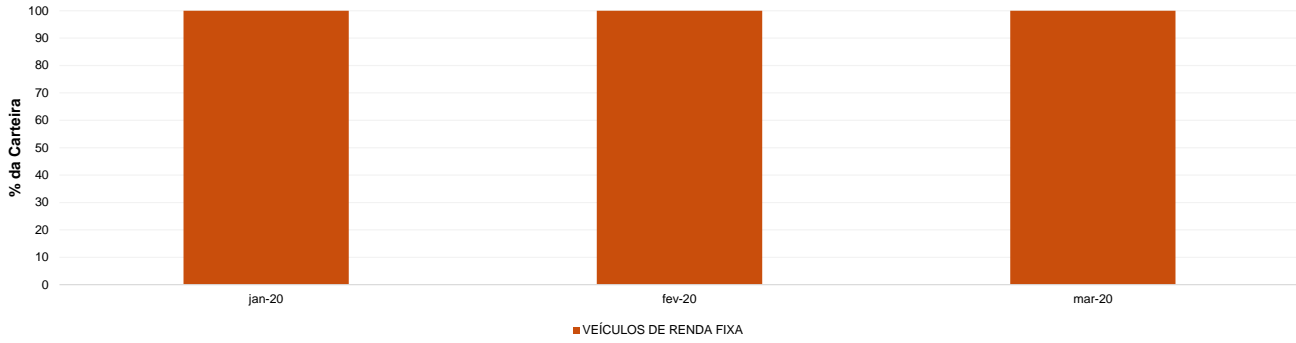
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

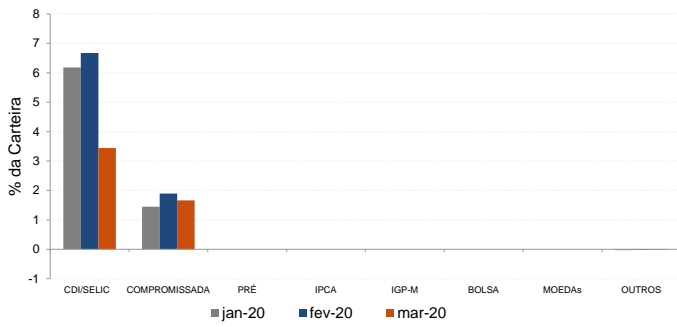
Distribuição da Carteira

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.

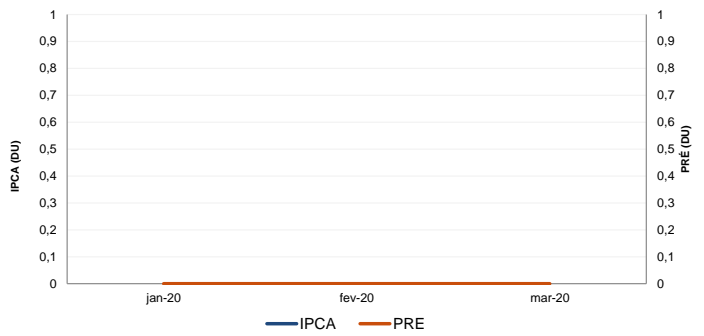
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2020

Análises de Contrapartes

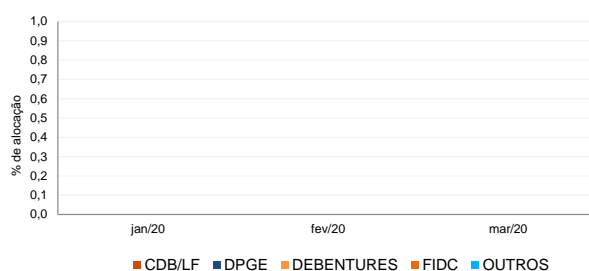
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2020

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	1.555	0,02%	Selic	20-mar-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.382	0,02%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	8.810	0,14%	Selic	05-mar-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.313	0,02%	Selic	02-mar-20	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	271	0,00%	Selic	23-mar-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II