

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2020

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	6.306.797,38	100%			1,23%	3,36%	5,59%	8,85%	10,24%	20,11%	32,85%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.				1,13%	3,16%	4,84%	5,93%	7,42%	14,26%	22,42%
Renda Fixa ALM	5.874.355,17	93,16%									
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.874.355,17	93,16%	100%		1,33%	3,68%	6,06%	9,60%	11,13%	21,96%	35,52%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,23%	3,50%	5,55%	7,23%	8,85%	17,35%	27,42%
Renda Fixa CDI	432.442,21	6,86%		0,15%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	432.442,21	6,86%	BRADESCO	0,00%	0,15%	0,13%	0,23%	0,79%	2,29%	2,67%	8,88%
Benchmark:	CDI				0,15%	0,46%	1,04%	2,60%	2,99%	9,26%	16,33%
Total	6.305.548,37	100%		0,01%	1,23%	3,36%	5,59%	8,85%	10,24%	20,11%	32,85%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,23%	3,50%	5,55%	7,23%	8,85%	17,35%	27,42%

* 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.

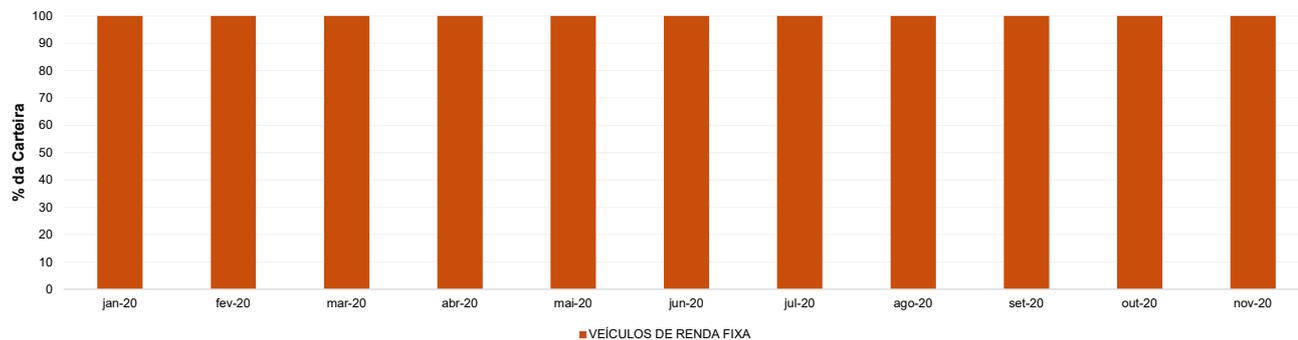
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

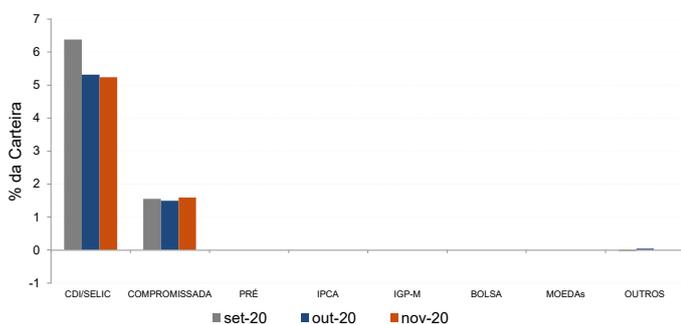
Distribuição da Carteira

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.

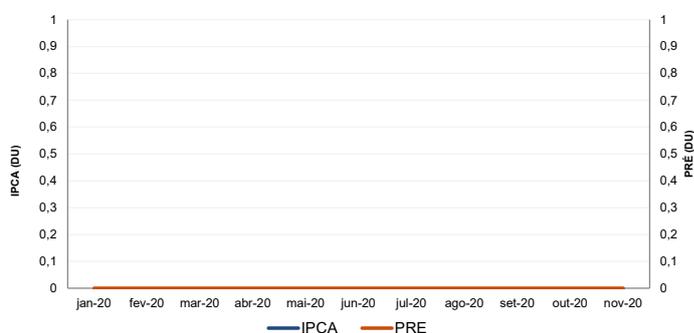
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2020

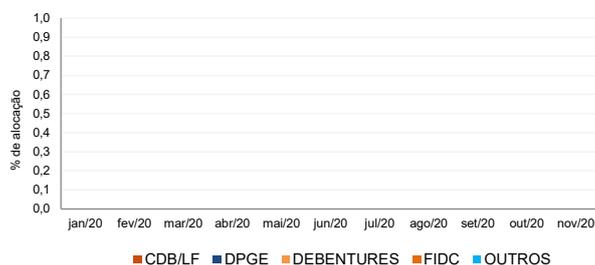
Análises de Contrapartes

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
------	------	---	---------------------------

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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: 30/11/2020

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	7.381	0,12%	Selic	16-nov-20	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.412	0,09%	Selic	13-nov-20	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

