

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 | ALOCÇÃO (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% | 15,86% |
| 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.

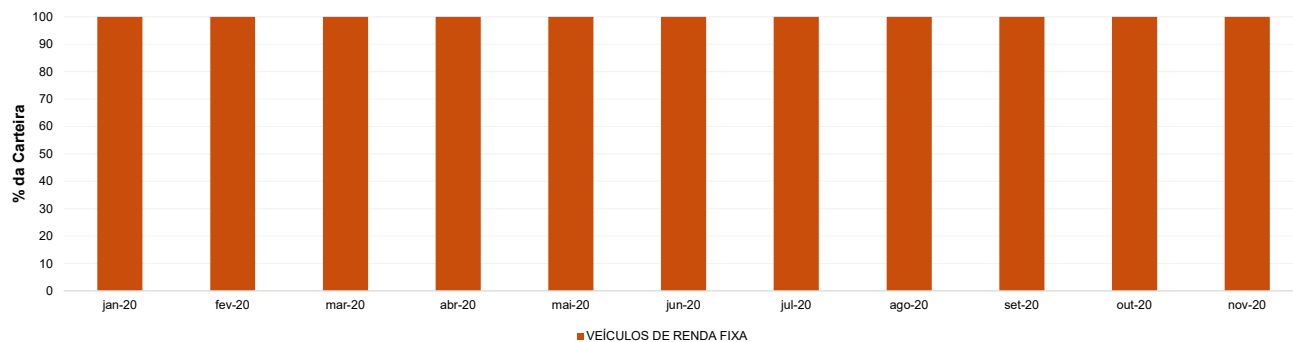
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

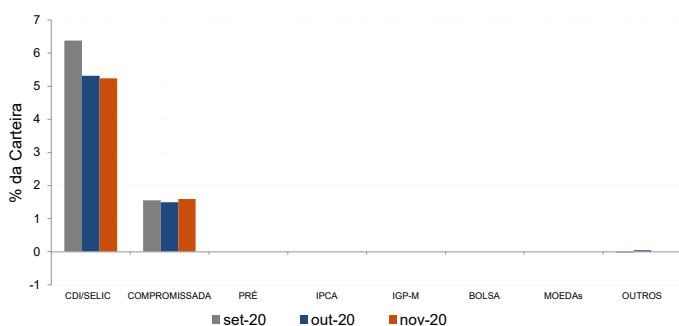
Distribuição da Carteira

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.

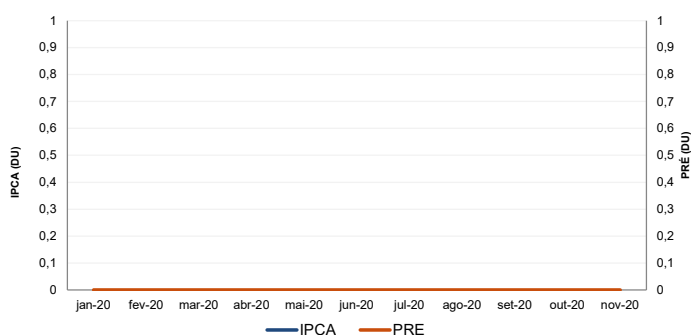
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2020

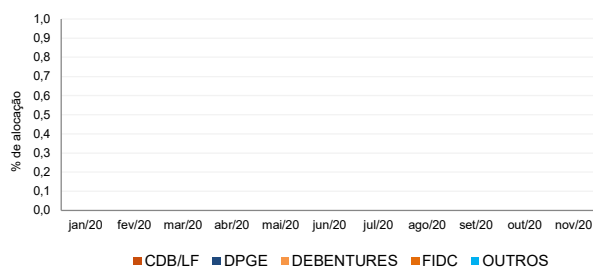
Análises de Contrapartes

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 |

