

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/10/2020

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	6.294.819,71	100%				1,25%	2,89%	4,39%	7,53%	9,68%	19,36%	32,31%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					1,11%	2,50%	3,52%	4,75%	7,01%	13,02%	21,68%
Renda Fixa ALM	5.861.556,19	93,14%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.861.556,19	93,14%		100%		1,36%	3,16%	4,76%	8,16%	10,52%	21,13%	34,90%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,22%	2,85%	4,22%	5,92%	8,44%	16,07%	26,65%
Renda Fixa CDI	433.263,52	6,88%			0,19%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	433.263,52	6,88%	BRADESCO	0,00%	0,19%	0,11%	0,26%	0,90%	2,17%	2,93%	9,28%	16,37%
Benchmark:	CDI					0,16%	0,48%	1,13%	2,45%	3,22%	9,63%	16,82%
Total	6.293.506,54	100%			0,01%	1,25%	2,89%	4,39%	7,53%	9,68%	19,36%	32,31%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,22%	2,85%	4,22%	5,92%	8,44%	16,07%	26,65%

* 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.

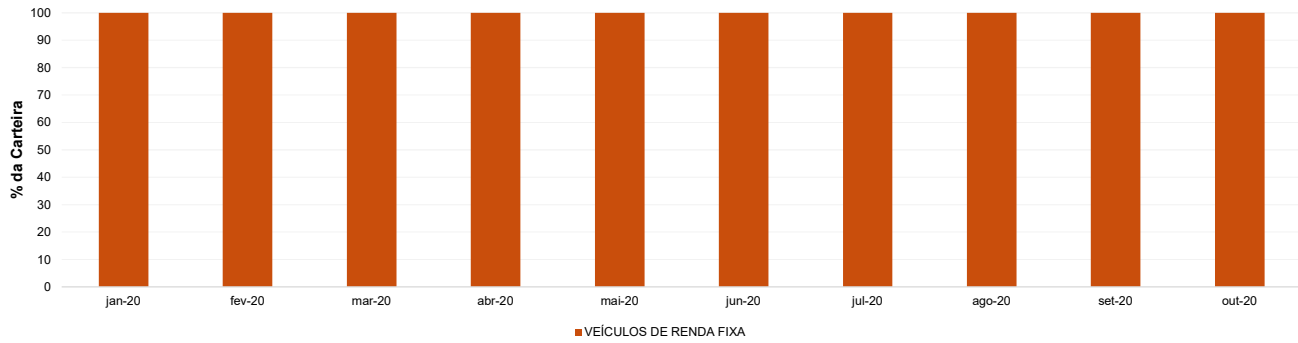
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

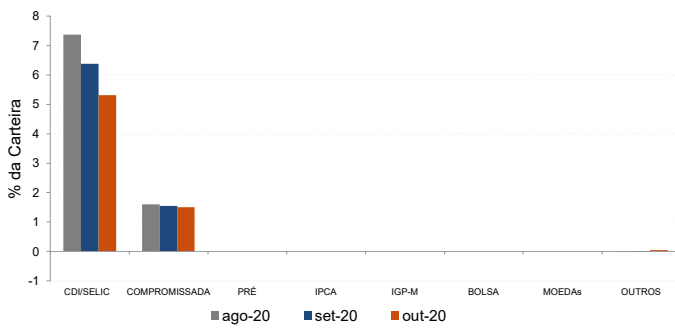
Distribuição da Carteira

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.

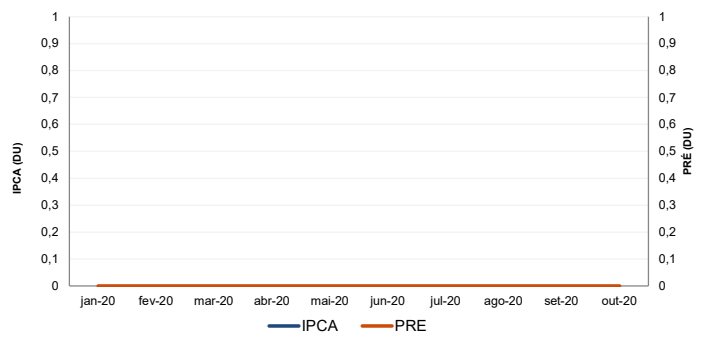
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/10/2020

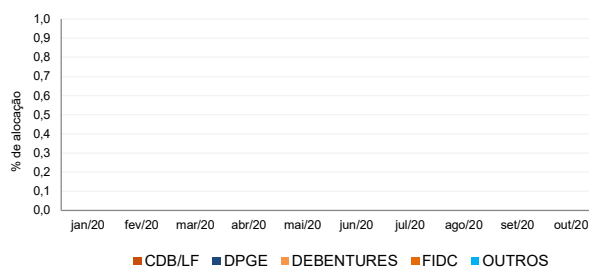
Análises de Contrapartes

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: 30/10/2020

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	2.286	0,04%	Selic	14-out-20	5,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.600	0,03%	Selic	08-out-20	0,15%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.143	0,02%	Selic	14-out-20	5,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	960	0,02%	Selic	07-out-20	0,17%	0,17%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	591	0,01%	Selic	26-out-20	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

