

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2020

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	6.281.548,46	100%				0,84%	2,51%	3,52%	6,20%	8,92%	19,11%	31,82%
Benchmark:	IPCA + 3% a.a.					0,89%	2,02%	2,31%	3,60%	6,23%	12,57%	21,15%
Renda Fixa ALM	5.782.821,76	92,08%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.782.821,76	92,08%		100%		0,94%	2,71%	3,80%	6,70%	9,68%	20,83%	34,31%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,00%	2,37%	3,00%	4,64%	7,66%	15,62%	26,10%
Renda Fixa CDI	498.726,70	7,94%			0,14%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	498.726,70	7,94%	BRADESCO	0,00%	0,14%	-0,01%	0,34%	1,06%	2,05%	3,31%	9,75%	17,00%
Benchmark:	CDI					0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%
Total	6.280.242,39	100%			0,01%	0,84%	2,51%	3,52%	6,20%	8,92%	19,11%	31,82%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,00%	2,37%	3,00%	4,64%	7,66%	15,62%	26,10%

* 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.

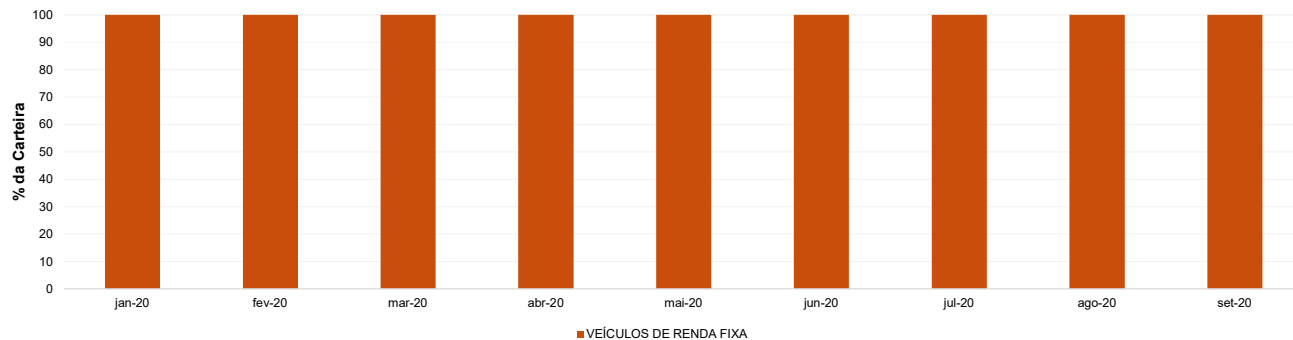
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

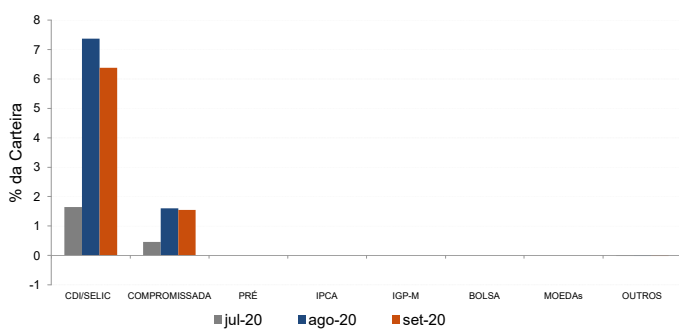
Distribuição da Carteira

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.

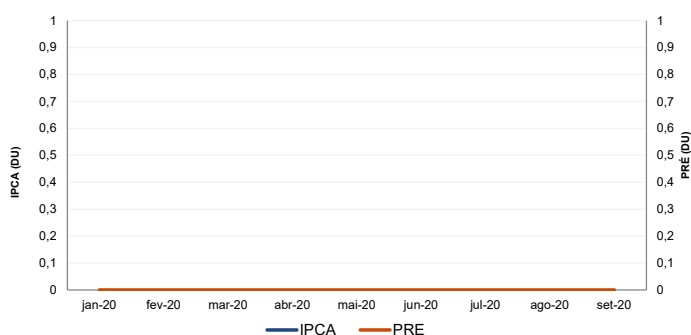
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2020

Análises de Contrapartes

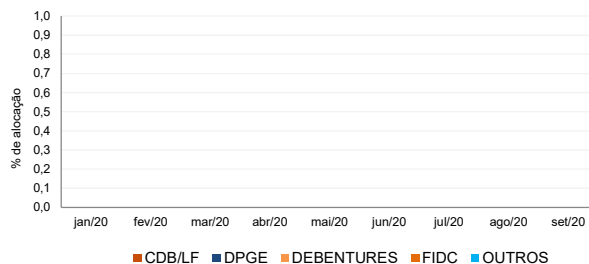
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 30/09/2020

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	1.217	0,02%	Selic	09-set-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	824	0,01%	Selic	10-set-20	0,02%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	319	0,01%	Selic	09-set-20	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.541	0,06%	Selic	23-set-20	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.770	0,03%	Selic	28-set-20	7,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.770	0,03%	Selic	28-set-20	7,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.539	0,02%	Selic	28-set-20	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.767	0,03%	Selic	23-set-20	7,00%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.697	0,03%	Selic	30-set-20	0,14%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	884	0,01%	Selic	28-set-20	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.532	0,06%	Selic	23-set-20	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.119	0,03%	Selic	28-set-20	0,12%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.695	0,03%	Selic	30-set-20	0,15%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.693	0,03%	Selic	30-set-20	0,17%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	881	0,01%	Selic	23-set-20	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	4.398	0,07%	Selic	23-set-20	0,09%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.733	0,04%	Selic	04-set-20	4,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	2.490	0,04%	Selic	10-set-20	4,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

