

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2021

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	7.769.862,88	100%				1,24%	3,53%	7,16%	9,36%	14,87%	24,78%	36,44%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,96%	2,64%	5,04%	6,37%	10,77%	14,61%	19,71%
Renda Fixa ALM	6.667.577,46	85,83%			0,02%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.667.577,46	85,83%		100%	0,02%	1,39%	3,99%	8,06%	10,47%	16,53%	27,39%	40,32%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,25%	3,52%	6,83%	8,73%	14,48%	22,41%	32,10%
Renda Fixa CDI	1.102.285,42	14,19%			0,02%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.102.285,42	14,19%	BRADESCO	0,02%	0,02%	0,44%	1,16%	1,80%	2,06%	2,52%	6,41%	13,04%
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%
Total	7.768.242,80	100%			0,01%	1,24%	3,53%	7,16%	9,36%	14,87%	24,78%	36,44%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,25%	3,52%	6,83%	8,73%	14,48%	22,41%	32,10%

* 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.

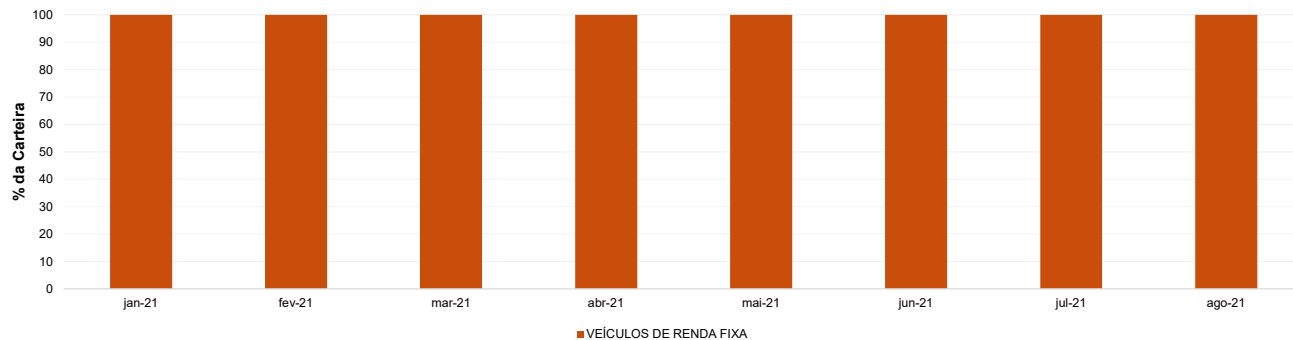
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

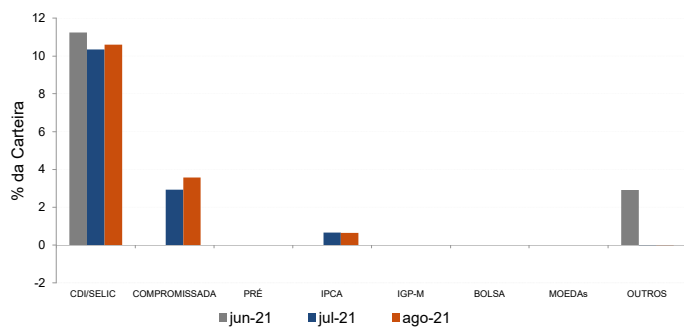
Distribuição da Carteira

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.

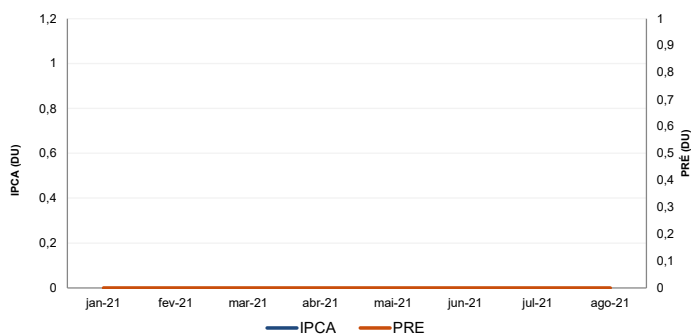
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2021

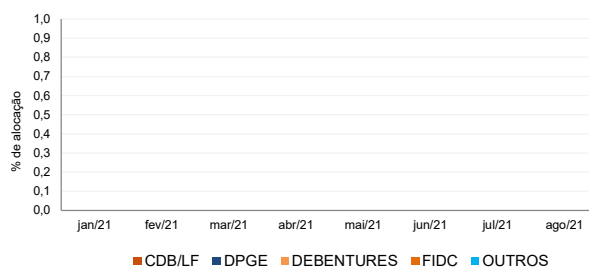
Análises de Contrapartes

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: 31/08/2021

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 2022-09-01	01-set-22	2.820	0,04%	Selic	19-ago-21	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	24.603	0,32%	Selic	30-ago-21	0,17%	0,17%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

