

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 26/02/2021

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	6.280.227,18	100%			0,79%	3,71%	7,19%	2,05%	10,90%	22,19%	34,51%	
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,93%	2,72%	5,45%	1,26%	6,23%	11,59%	17,09%	
Renda Fixa ALM	5.988.878,89	95,38%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.988.878,89	95,38%		100%	0,84%	4,01%	7,84%	2,23%	11,81%	24,25%	37,42%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,17%	3,53%	7,15%	1,77%	9,76%	19,14%	29,21%	
Renda Fixa CDI	291.348,29	4,64%		0,05%								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	291.348,29	4,64%	BRADESCO	0,00%	0,05%	0,10%	0,48%	0,70%	0,26%	2,12%	7,76%	14,60%
Benchmark:	CDI				0,13%	0,45%	0,92%	0,28%	2,37%	8,09%	15,02%	
Total	6.279.201,34	100%			0,00%	0,79%	3,71%	7,19%	2,05%	10,90%	22,19%	34,51%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,17%	3,53%	7,15%	1,77%	9,76%	19,14%	29,21%	

* 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.

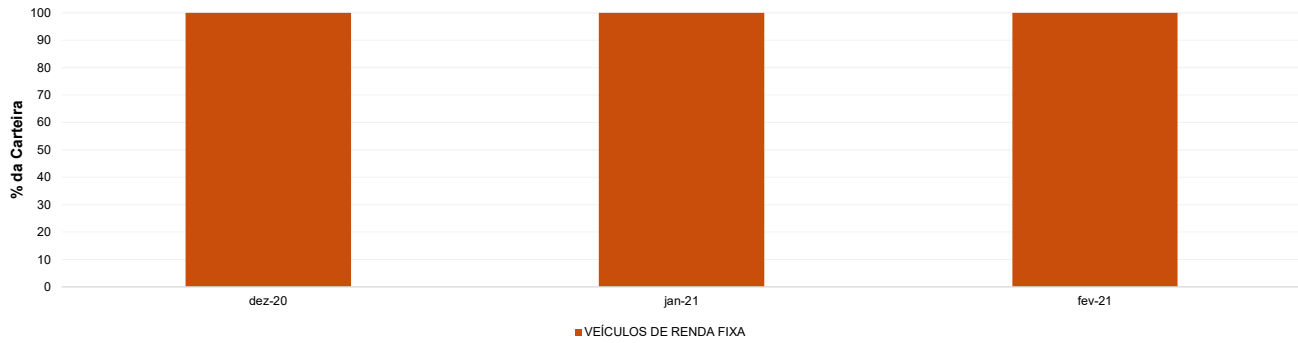
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

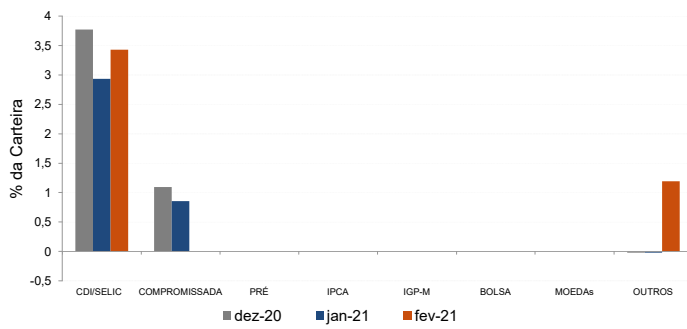
Distribuição da Carteira

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.

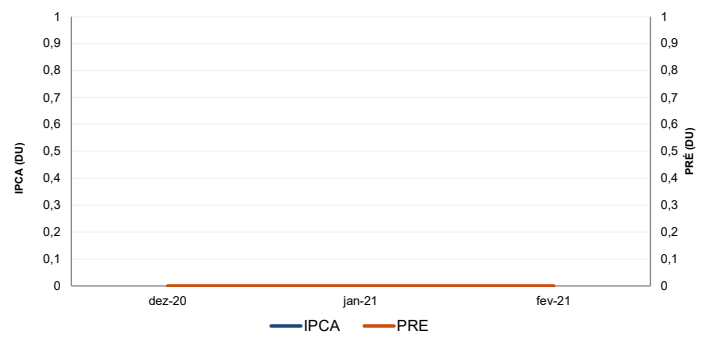
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 26/02/2021

Análises de Contrapartes

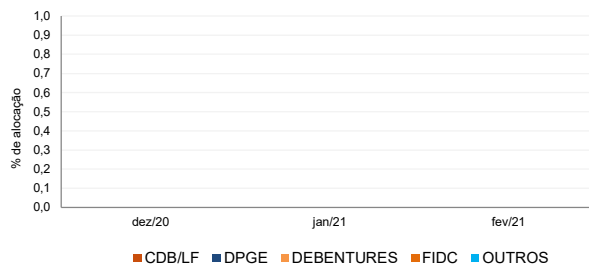
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
------	------	---	---------------------------

* 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: 26/02/2021

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 2021-09-01	01-set-21	944	0,02%	Selic	05-fev-21	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	11.997	0,19%	Selic	11-fev-21	0,12%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.428	0,05%	Selic	04-fev-21	0,12%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

