

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/01/2021

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	6.298.048,45	100%				1,25%	4,17%	7,17%	1,25%	10,61%	22,13%	34,32%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Renda Fixa ALM	6.059.302,72	96,23%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.059.302,72	96,23%		100%		1,38%	4,52%	7,82%	1,38%	11,52%	24,21%	37,21%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,59%	3,60%	6,55%	0,59%	9,09%	18,68%	28,52%
Renda Fixa CDI	238.745,73	3,79%			0,06%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	238.745,73	3,79%	BRADESCO	0,00%	0,06%	0,16%	0,50%	0,76%	0,16%	2,30%	8,18%	15,02%
Benchmark:	CDI					0,15%	0,46%	0,94%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%
Total	6.296.800,30	100%			0,00%	1,25%	4,17%	7,17%	1,25%	10,61%	22,13%	34,32%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,59%	3,60%	6,55%	0,59%	9,09%	18,68%	28,52%

* 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.

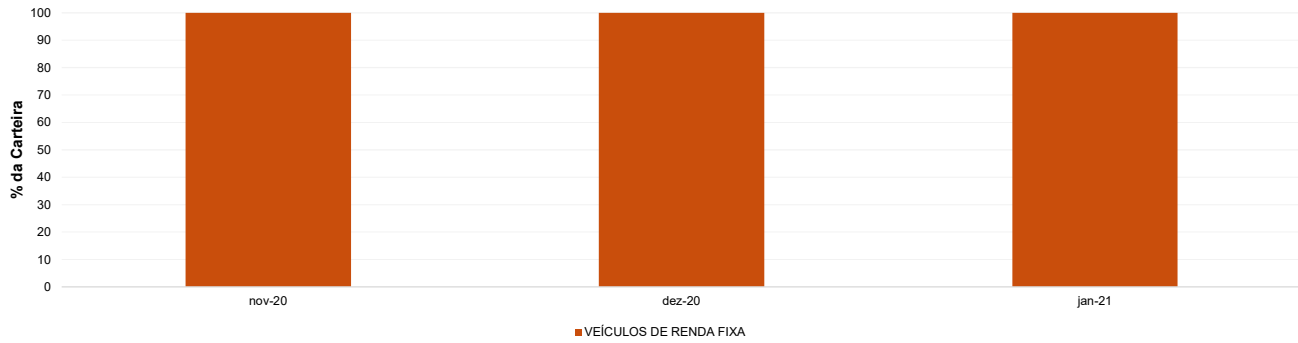
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

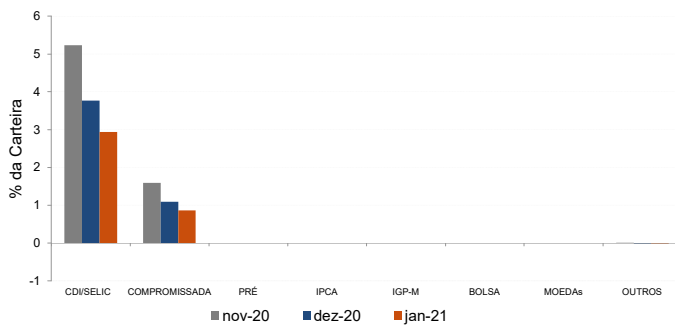
Distribuição da Carteira

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.

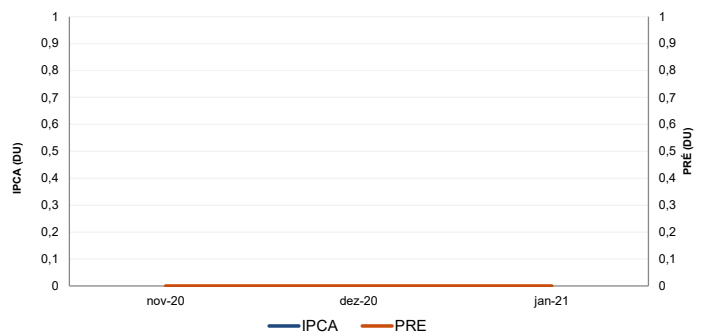
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/01/2021

Análises de Contrapartes

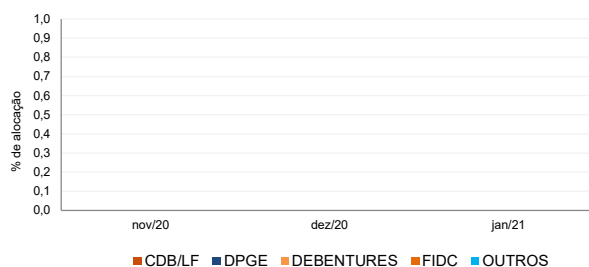
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/01/2021

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 2021-03-01	01-mar-21	2.856	0,05%	Selic	27-jan-21	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	577	0,01%	Selic	14-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	490	0,01%	Selic	12-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	288	0,00%	Selic	14-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.009	0,02%	Selic	27-jan-21	0,10%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.871	0,05%	Selic	27-jan-21	0,13%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

