

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/07/2021

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	7.743.061,04	100%				1,11%	3,21%	6,69%	8,02%	14,34%	24,08%	35,76%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,05%	2,60%	5,02%	5,36%	10,08%	13,74%	18,57%
Renda Fixa ALM	6.715.156,64	86,74%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.715.156,64	86,74%		100%	0,01%	1,25%	3,65%	7,47%	8,96%	15,87%	26,54%	39,47%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,46%	6,75%	7,38%	13,74%	21,49%	30,87%
Renda Fixa CDI	1.027.904,40	13,28%			0,05%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.027.904,40	13,28%	BRADESCO	0,01%	0,05%	0,39%	1,00%	1,45%	1,61%	2,22%	6,47%	13,18%
Benchmark:	CDI					0,36%	0,93%	1,48%	1,63%	2,43%	6,77%	13,54%
Total	7.741.451,33	100%			0,01%	1,11%	3,21%	6,69%	8,02%	14,34%	24,08%	35,76%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,46%	6,75%	7,38%	13,74%	21,49%	30,87%

* 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.

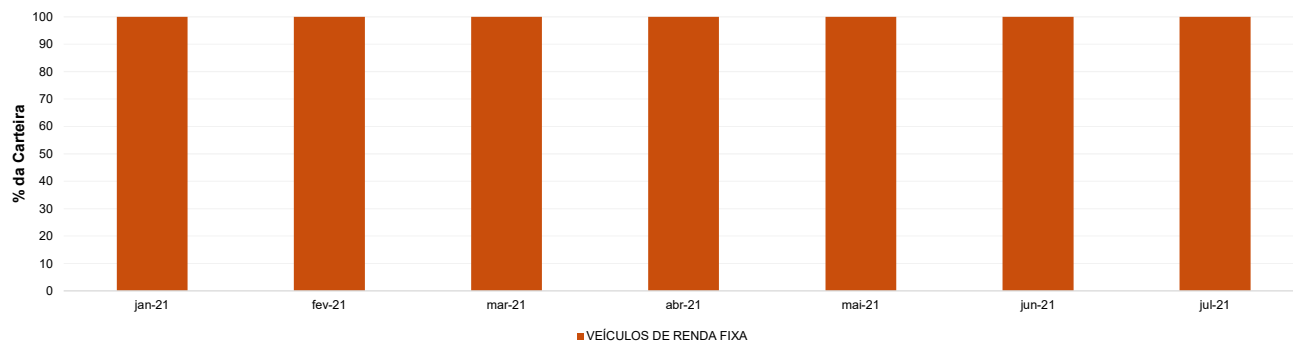
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

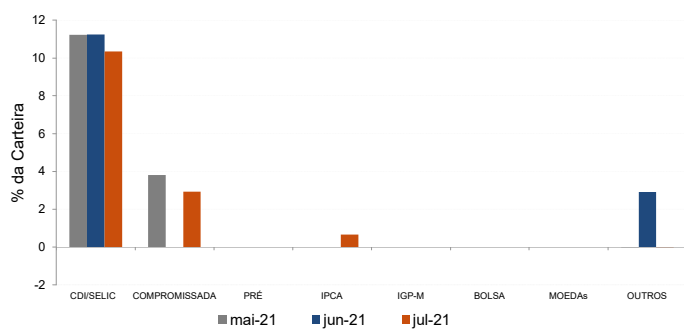
Distribuição da Carteira

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.

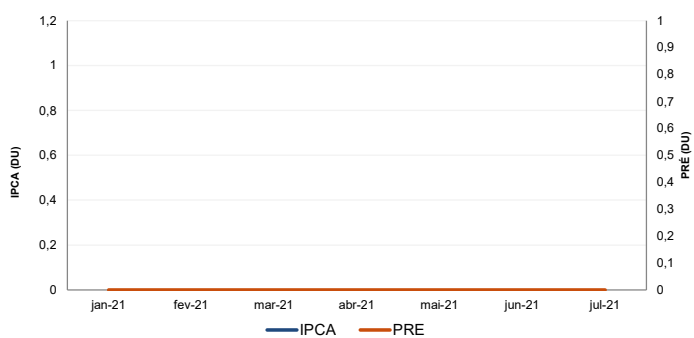
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/07/2021

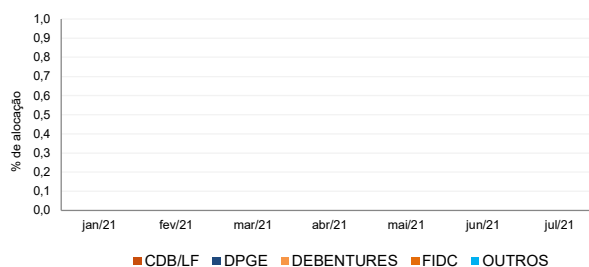
Análises de Contrapartes

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: 30/07/2021

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 2022-03-01	01-mar-22	16.209	0,21%	Selic	23-jul-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	16.209	0,21%	Selic	14-jul-21	0,12%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	30.750	0,40%	Selic	14-jul-21	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	16.184	0,21%	Selic	23-jul-21	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	33.613	0,43%	Selic	09-jul-21	0,15%	0,15%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

