

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2021

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	7.725.857,86	100%				1,14%	2,94%	6,83%	6,83%	14,08%	23,56%	36,05%	
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%	
Renda Fixa ALM	6.632.512,39	85,87%											
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.632.512,39	85,87%		100%		1,30%	3,42%	7,62%	7,62%	15,50%	25,91%	39,56%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,89%	2,76%	5,96%	5,96%	13,08%	20,59%	30,05%	
Renda Fixa CDI	1.093.345,47	14,15%			0,05%								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.093.345,47	14,15%	BRADESCO	0,02%	0,05%	0,32%	0,75%	1,21%	1,21%	2,01%	6,65%	13,34%	
Benchmark:	CDI					0,30%	0,78%	1,27%	1,27%	2,27%	6,99%	13,75%	
Total	7.724.321,98	100%				0,01%	1,14%	2,94%	6,83%	6,83%	14,08%	23,56%	36,05%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,89%	2,76%	5,96%	5,96%	13,08%	20,59%	30,05%	

* 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.

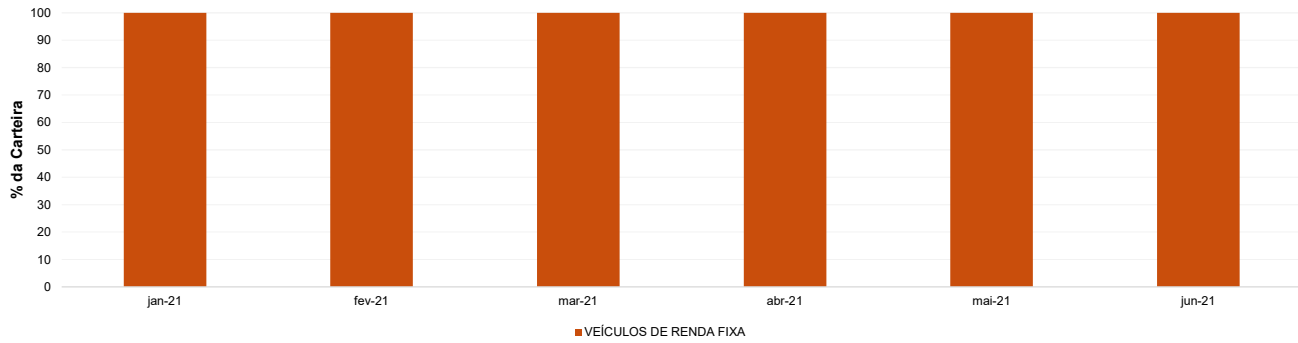
RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2021

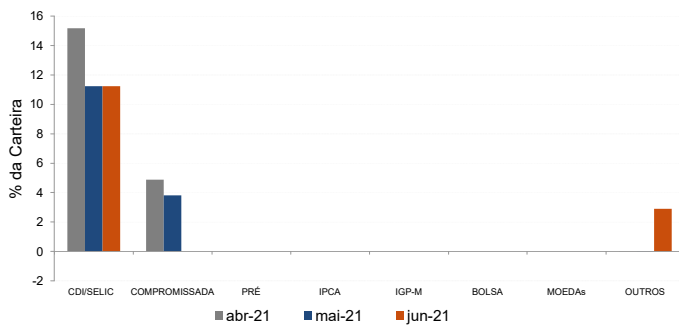
Distribuição da Carteira

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.

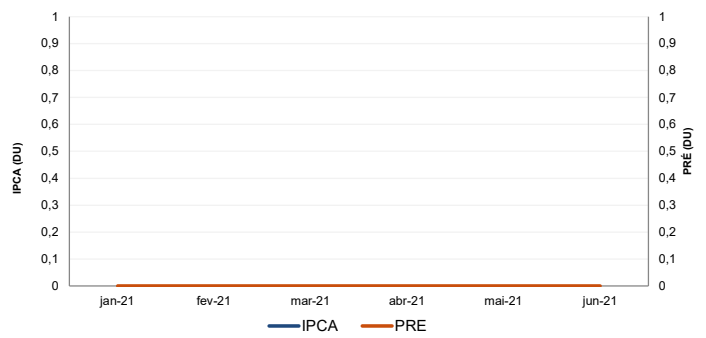
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2021

Análises de Contrapartes

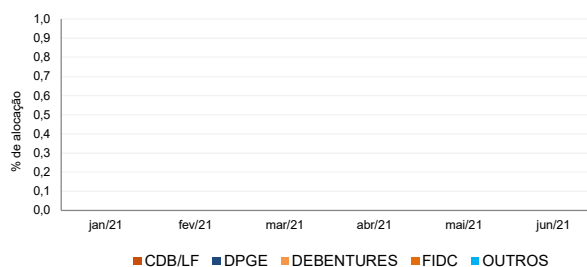
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 30/06/2021

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	8.210	0,11%	Selic	10-jun-21	0,11%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	21.214	0,27%	Selic	07-jun-21	0,24%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

