

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>7.706.742,84</b>	<b>100%</b>				<b>0,93%</b>	<b>3,51%</b>	<b>7,35%</b>	<b>5,63%</b>	<b>13,36%</b>	<b>22,72%</b>	<b>36,32%</b>
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
<b>Renda Fixa ALM</b>	<b>6.547.427,28</b>	<b>84,97%</b>										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.547.427,28	84,97%		100%		1,06%	3,92%	8,08%	6,23%	14,63%	24,90%	39,74%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,19%	3,20%	6,85%	5,03%	12,78%	19,92%	31,00%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>1.159.315,56</b>	<b>15,05%</b>			<b>0,05%</b>							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.159.315,56	15,05%	BRADESCO	0,02%	0,05%	0,29%	0,63%	1,11%	0,89%	1,91%	6,80%	13,56%
Benchmark:	CDI					0,27%	0,67%	1,13%	0,96%	2,18%	7,17%	14,00%
<b>Total</b>	<b>7.705.212,84</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>	<b>0,93%</b>	<b>3,51%</b>	<b>7,35%</b>	<b>5,63%</b>	<b>13,36%</b>	<b>22,72%</b>	<b>36,32%</b>
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,19%	3,20%	6,85%	5,03%	12,78%	19,92%	31,00%

\* 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.

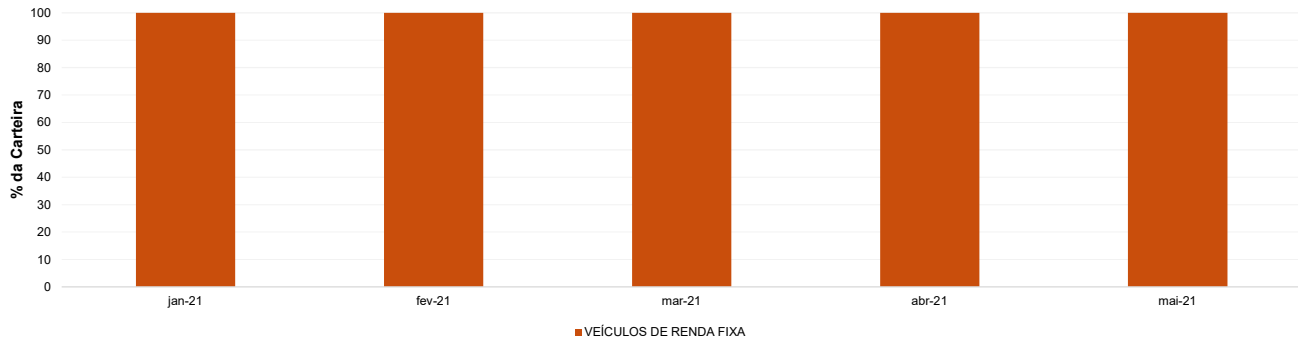
RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2021

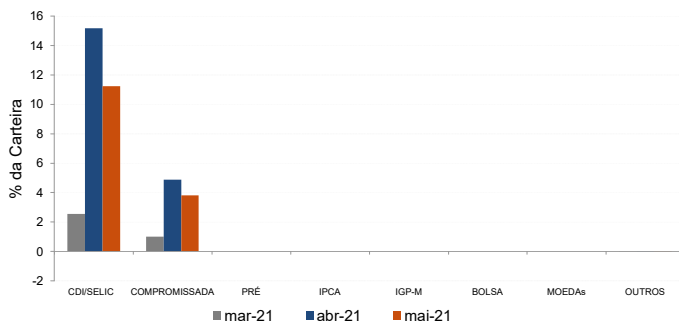
## Distribuição da Carteira

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.

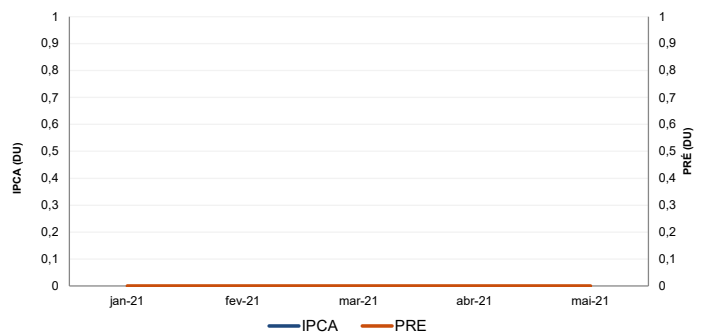
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2021

## Análises de Contrapartes

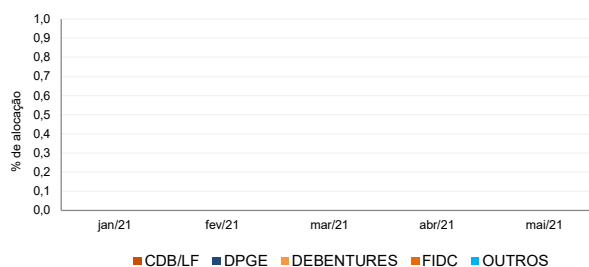
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2021

## 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 2023-03-01	01-mar-23	12.374	0,16%	Selic	05-mai-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	50.946	0,66%	IPCA	05-mai-21	3,12%	3,08%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	68.257	0,89%	IPCA	05-mai-21	3,47%	3,46%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	304.489	3,95%	IPCA	05-mai-21	3,88%	3,88%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	135.439	1,76%	IPCA	05-mai-21	4,10%	4,08%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	16.910	0,22%	IPCA	05-mai-21	4,15%	4,14%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	34.683	0,45%	IPCA	05-mai-21	4,37%	4,36%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	39.632	0,51%	IPCA	05-mai-21	4,58%	4,59%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C

