

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2021

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	6.319.477,23	100%				1,70%	3,78%	8,11%	3,78%	11,91%	23,12%	35,79%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,02%	2,30%	5,76%	2,30%	7,15%	11,81%	18,08%
Renda Fixa ALM	6.095.514,67	96,48%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.095.514,67	96,48%		100%		1,78%	4,05%	8,73%	4,05%	12,86%	25,17%	38,83%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,33%	3,12%	7,50%	3,12%	10,72%	19,44%	30,34%
Renda Fixa CDI	223.962,56	3,54%			0,06%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	223.962,56	3,54%	BRADESCO	0,00%	0,06%	0,20%	0,46%	0,91%	0,46%	1,98%	7,47%	14,22%
Benchmark:	CDI					0,20%	0,48%	0,96%	0,48%	2,23%	7,80%	14,63%
Total	6.318.183,06	100%			0,00%	1,70%	3,78%	8,11%	3,78%	11,91%	23,12%	35,79%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,33%	3,12%	7,50%	3,12%	10,72%	19,44%	30,34%

* 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.

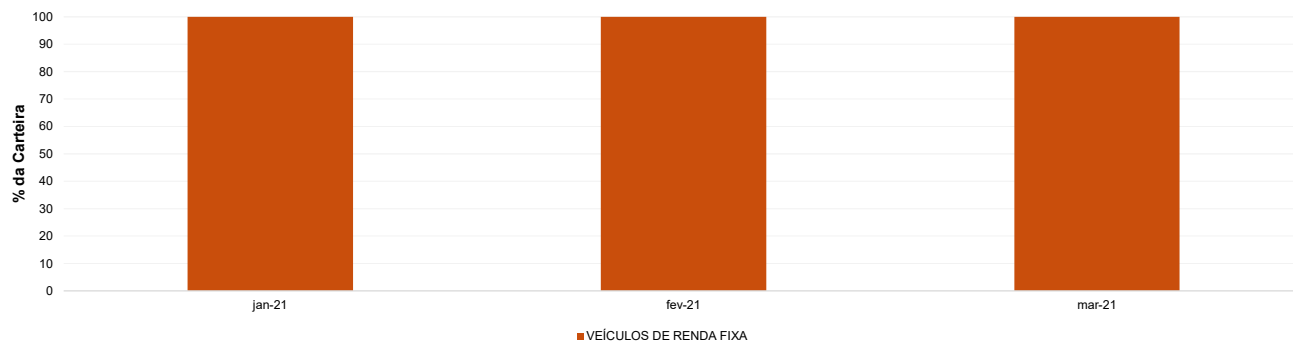
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

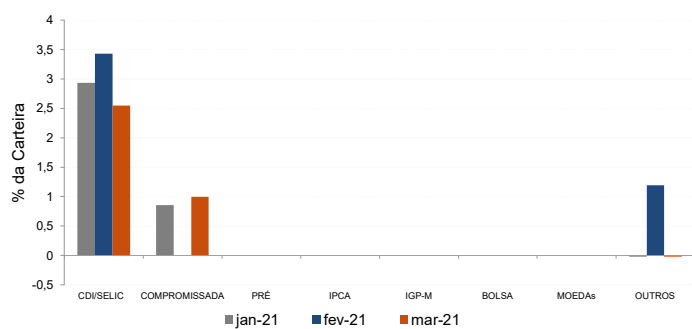
Distribuição da Carteira

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.

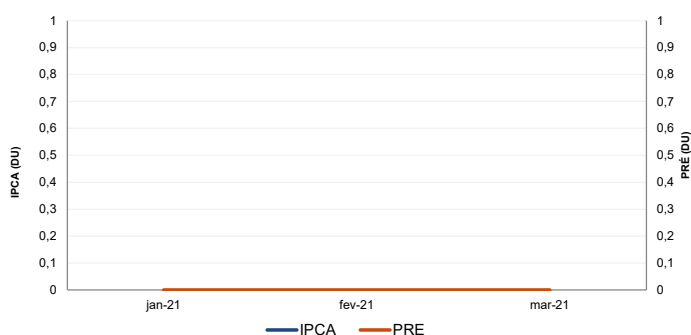
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2021

Análises de Contrapartes

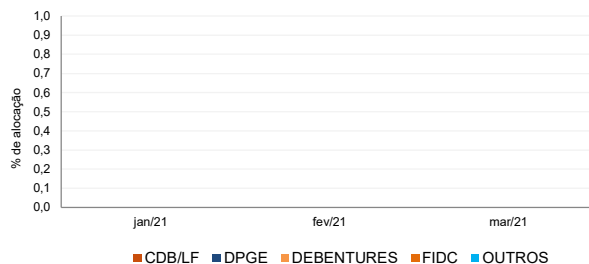
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2021

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	158	0,00%	Selic	25-mar-21	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	127	0,00%	Selic	18-mar-21	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	5.656	0,09%	Selic	29-mar-21	0,10%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	4.807	0,08%	Selic	05-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.828	0,04%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	396	0,01%	Selic	04-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	198	0,00%	Selic	04-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	187	0,00%	Selic	29-mar-21	0,10%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	154	0,00%	Selic	30-mar-21	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	58	0,00%	Selic	30-mar-21	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.021	0,03%	Selic	09-mar-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.530	0,02%	Selic	09-mar-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	4.223	0,07%	Selic	25-mar-21	0,18%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.408	0,02%	Selic	01-mar-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.081	0,03%	Selic	09-mar-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.975	0,03%	Selic	09-mar-21	0,19%	0,19%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.653	0,03%	Selic	09-mar-21	0,19%	0,19%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

