

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2021

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	7.881.221,29	100%			1,25%	4,30%	8,38%	15,78%	15,78%	28,09%	40,80%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,82%	3,21%	6,60%	11,16%	11,16%	17,34%	23,62%
Renda Fixa ALM	7.032.426,32	89,25%		0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.032.426,32	89,25%		100%	0,01%	1,34%	4,71%	9,32%	17,64%	17,64%	31,17%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,13%	4,07%	8,41%	14,87%	14,87%	25,31%
Renda Fixa CDI	848.794,97	10,77%		0,03%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	848.794,97	10,77%	BRADESCO	0,02%	0,03%	0,76%	1,89%	3,22%	4,48%	4,48%	7,10%
Benchmark:	CDI					0,76%	1,84%	3,09%	4,40%	4,40%	7,28%
Total	7.879.656,64	100%			0,01%	1,25%	4,30%	8,38%	15,78%	15,78%	28,09%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,13%	4,07%	8,41%	14,87%	14,87%	25,31%

* 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.

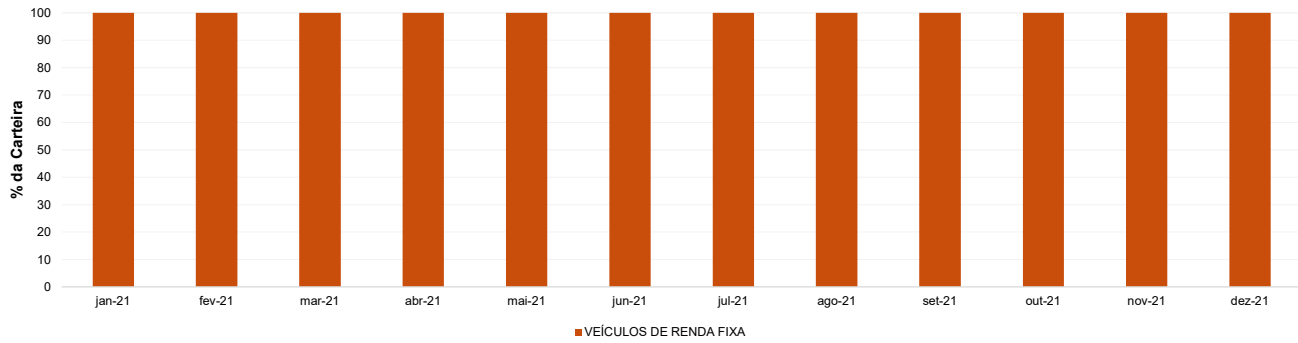
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

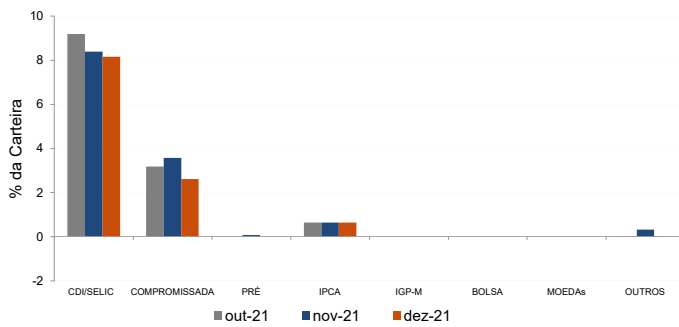
Distribuição da Carteira

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.

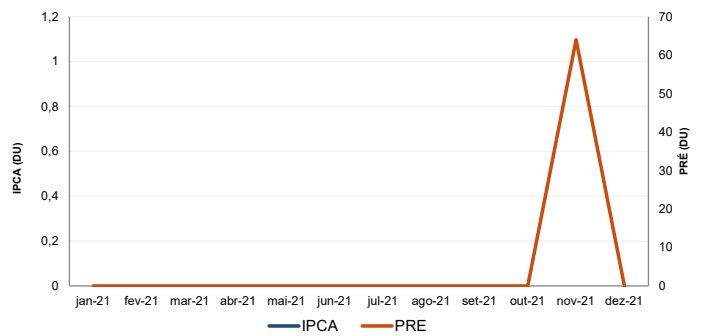
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2021

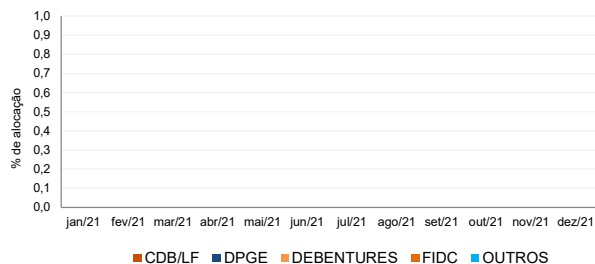
Análises de Contrapartes

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: 31/12/2021

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	4.698	0,06%	Selic	13-dez-21	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.315	0,02%	Selic	30-dez-21	7,00%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.315	0,02%	Selic	07-dez-21	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	956	0,01%	Selic	09-dez-21	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	188	0,00%	Selic	09-dez-21	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	18.787	0,24%	Selic	22-dez-21	4,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	9.375	0,12%	Selic	14-dez-21	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	6.934	0,09%	Selic	10-dez-21	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.659	0,06%	Selic	14-dez-21	0,20%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

