

## RBSPREV PLANO CV

A Entidade acompanhará os indicadores definidos na política de investimentos para evidenciar a capacidade de pagamento de suas obrigações com os participantes. Tais indicadores foram baseados nos índices de liquidez desenvolvidos pela PREVIC e publicados no Relatório de Estabilidade da Previdência Complementar, com adaptação de metodologia para adequação das informações disponíveis.

Não serão estabelecidos parâmetros mínimos, sem prejuízo de vir a agir quando os níveis dos índices a seguir apresentados estiverem abaixo de 1.

### Parâmetros

Data-base dos Ativos: **31/12/2021**  
Data de Avaliação do Passivo: **31/12/2020**

### ILG - Índice de Liquidez Global

O índice de liquidez global (ILG) tem por objetivo mensurar a disponibilidade de ativos líquidos, independentemente dos respectivos prazos de vencimento ou da volatilidade, para fazer frente às obrigações com participantes projetadas para cinco anos.

Ativos de Liquidez nível 1: 166.645.470,51  
Ações Nível 1: 5.322.393,27  
VP Passivo - Próximos 5 anos: -3.197.115,55

**ILG** **53,79**

Quando superior a um, o índice informa a existência de fluxos de ativos com liquidez em montante superior aos passivos atuariais líquidos, indicando que não há insuficiência de ativos para cobrir as obrigações.

### ILCP - Índice de Liquidez de Curto Prazo

O índice de liquidez de curto prazo (ILCP) relaciona o valor presente (VP) dos títulos de renda fixa em carteira (títulos públicos, títulos privados e operações compromissadas) de prazos de vencimentos curtos (até cinco anos) com os VP das obrigações atuariais líquidas das contribuições, no mesmo prazo (até cinco anos).

Inflação: 75.341.970,94  
Pré: 349.058,43  
Outros: 68.829.669,22  
Valor Total RF: 144.520.698,60  
VP Passivo - Próximos 5 anos: -3.197.115,55

**ILCP** **45,20**

Quando superior a um, o índice informa a existência de fluxos de renda fixa em montante superior aos passivos atuariais líquidos, indicando menor necessidade de realizar outros ativos para cobrir as obrigações no período de referência. Portanto, o ILCP maior tende a reduzir a exposição ao risco de mercado.

