

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2021

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           |
| <b>Renda Fixa</b>                          | <b>7.913.872,45</b> | <b>100%</b>   |          |            |                  | <b>1,61%</b>   | <b>4,57%</b> | <b>8,26%</b> | <b>14,35%</b> | <b>16,22%</b> | <b>28,12%</b> | <b>39,59%</b> |
| Benchmark:                                 | IPCA + 1% a.a.      |               |          |            |                  | 1,03%          | 3,65%        | 6,38%        | 10,25%        | 11,84%        | 17,82%        | 22,89%        |
| <b>Renda Fixa ALM</b>                      | <b>6.939.132,39</b> | <b>87,70%</b> |          |            | <b>0,02%</b>     |                |              |              |               |               |               |               |
| RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR | 6.939.132,39        | 87,70%        |          | 100%       | 0,02%            | 1,77%          | 5,08%        | 9,27%        | 16,08%        | 18,10%        | 31,25%        | 44,04%        |
| Benchmark:                                 | IPCA + 4.39% a.a.   |               |          |            |                  | 1,29%          | 4,48%        | 8,15%        | 13,59%        | 15,56%        | 25,79%        | 35,61%        |
| <b>Renda Fixa CDI</b>                      | <b>974.740,06</b>   | <b>12,32%</b> |          |            | <b>0,03%</b>     |                |              |              |               |               |               |               |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II               | 974.740,06          | 12,32%        | BRADESCO | 0,02%      | 0,03%            | 0,59%          | 1,59%        | 2,77%        | 3,69%         | 3,91%         | 6,69%         | 13,14%        |
| Benchmark:                                 | CDI                 |               |          |            |                  | 0,59%          | 1,51%        | 2,62%        | 3,60%         | 3,77%         | 6,87%         | 13,38%        |
| <b>Total</b>                               | <b>7.912.480,75</b> | <b>100%</b>   |          |            | <b>0,02%</b>     | <b>1,61%</b>   | <b>4,57%</b> | <b>8,26%</b> | <b>14,35%</b> | <b>16,22%</b> | <b>28,12%</b> | <b>39,59%</b> |
| Benchmark:                                 | IPCA + 4.39% a.a.   |               |          |            |                  | 1,29%          | 4,48%        | 8,15%        | 13,59%        | 15,56%        | 25,79%        | 35,61%        |

\* 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.

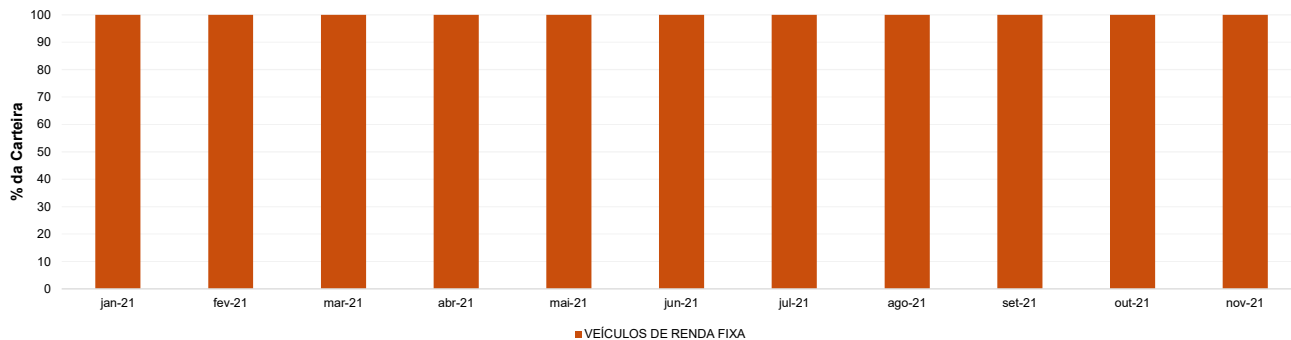
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

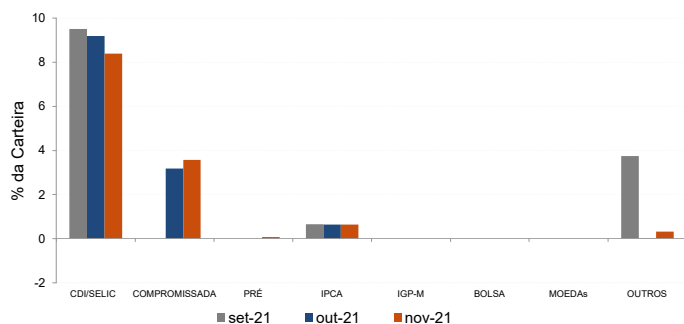
## Distribuição da Carteira

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.

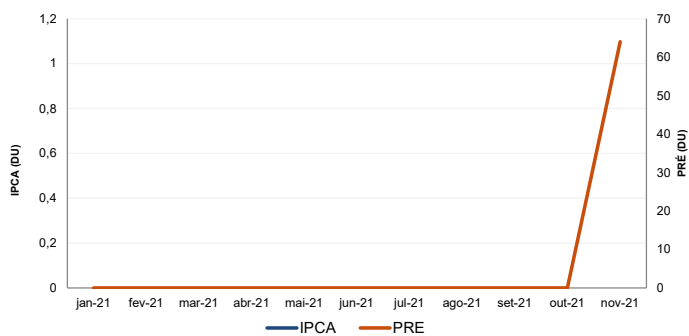
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2021

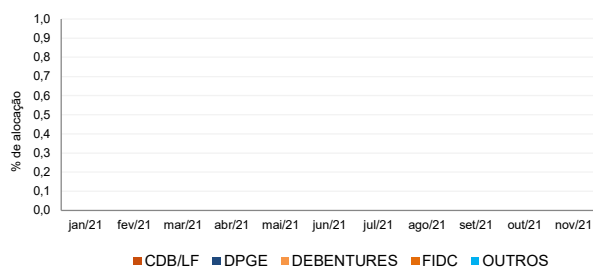
## Análises de Contrapartes

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: 30/11/2021

## 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  | 4.582 | 0,06%           | Selic     | 22-nov-21   | 4,00%        | 0,04%          | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2026-03-01   | 01-mar-26  | 7.229 | 0,09%           | Selic     | 09-nov-21   | 0,22%        | 0,00%          | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |

