

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/10/2021

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	7.856.955,92	100%				1,38%	4,19%	7,54%	12,54%	15,78%	26,99%	38,19%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,33%	3,57%	6,26%	9,13%	11,77%	17,30%	21,48%
Renda Fixa ALM	6.884.076,55	87,63%			0,02%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.884.076,55	87,63%		100%	0,02%	1,52%	4,69%	8,51%	14,06%	17,59%	29,96%	42,43%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,60%	4,43%	8,04%	12,14%	15,49%	25,24%	34,06%
Renda Fixa CDI	972.879,37	12,38%			0,03%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	972.879,37	12,38%	BRADESCO	0,02%	0,03%	0,53%	1,45%	2,47%	3,08%	3,44%	6,47%	13,03%
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%
Total	7.855.497,25	100%			0,01%	1,38%	4,19%	7,54%	12,54%	15,78%	26,99%	38,19%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,60%	4,43%	8,04%	12,14%	15,49%	25,24%	34,06%

* 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.

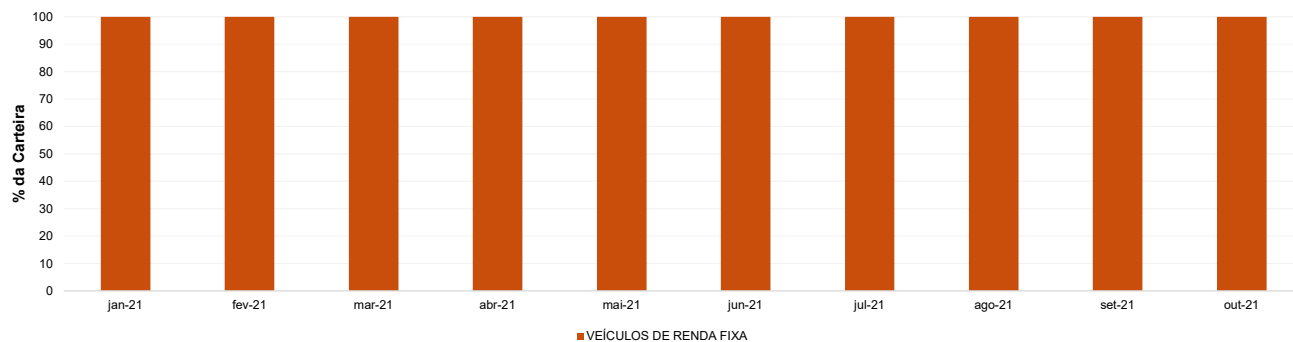
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

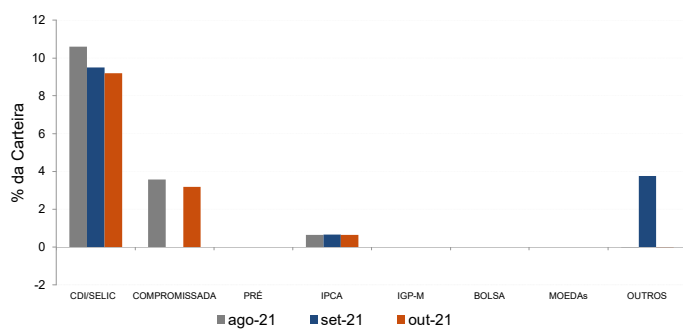
Distribuição da Carteira

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.

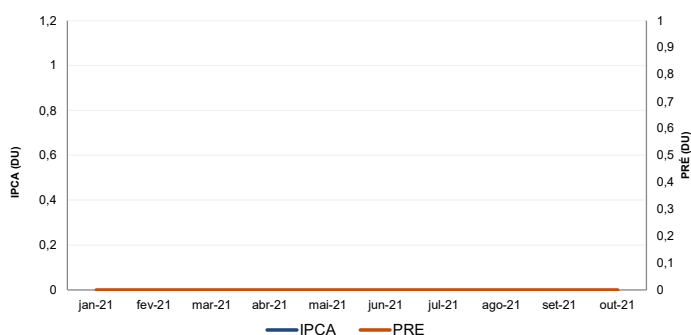
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/10/2021

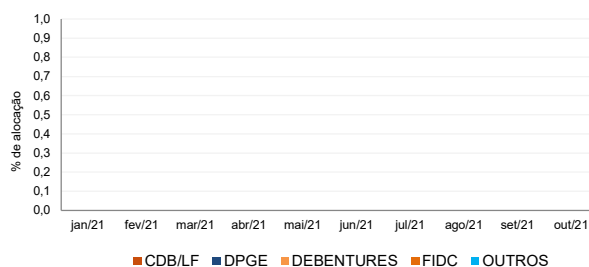
Análises de Contrapartes

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: 29/10/2021

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	19.477	0,25%	Selic	05-out-21	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	19.477	0,25%	Selic	25-out-21	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	15.578	0,20%	Selic	05-out-21	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

