

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>7.818.268,15</b>	<b>100%</b>				<b>1,51%</b>	<b>3,91%</b>	<b>6,96%</b>	<b>11,01%</b>	<b>15,64%</b>	<b>25,95%</b>	<b>37,74%</b>
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,24%	3,28%	5,28%	7,70%	11,34%	15,98%	20,53%
<b>Renda Fixa ALM</b>	<b>6.781.028,26</b>	<b>86,75%</b>			<b>0,01%</b>							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.781.028,26	86,75%		100%	0,01%	1,70%	4,40%	7,98%	12,35%	17,41%	28,77%	41,87%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,52%	4,17%	7,04%	10,38%	15,07%	23,88%	33,04%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>1.037.239,89</b>	<b>13,27%</b>			<b>0,02%</b>							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.037.239,89	13,27%	BRADESCO	0,02%	0,02%	0,47%	1,31%	2,08%	2,54%	3,00%	6,41%	13,04%
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%
<b>Total</b>	<b>7.816.716,69</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>	<b>1,51%</b>	<b>3,91%</b>	<b>6,96%</b>	<b>11,01%</b>	<b>15,64%</b>	<b>25,95%</b>	<b>37,74%</b>
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,52%	4,17%	7,04%	10,38%	15,07%	23,88%	33,04%

\* 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.

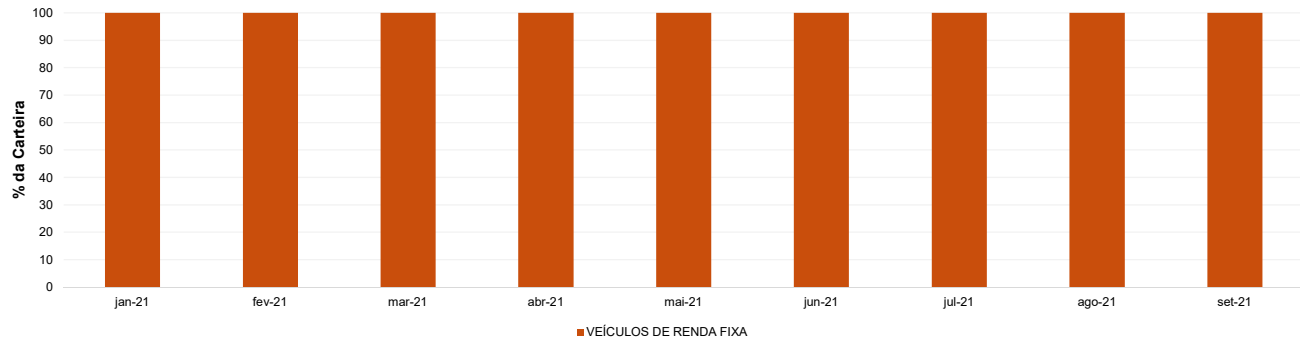
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

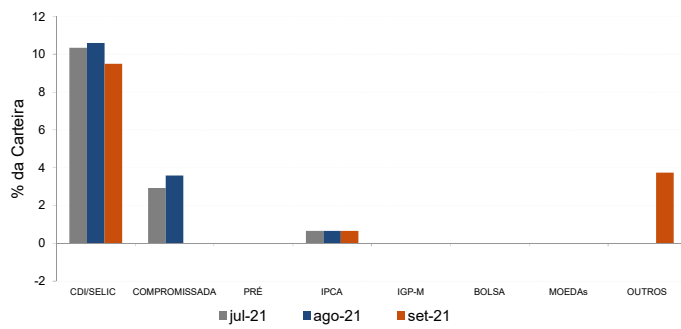
## Distribuição da Carteira

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.

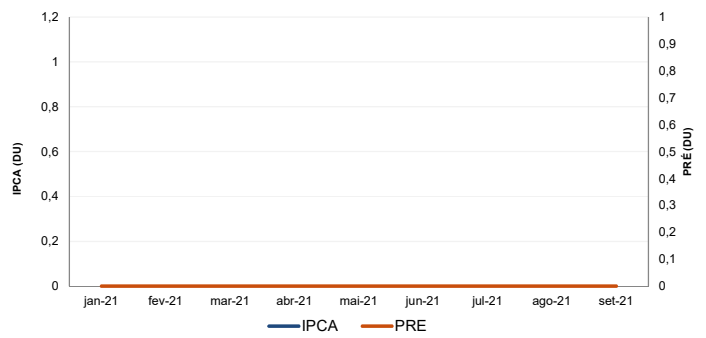
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2021

## Análises de Contrapartes

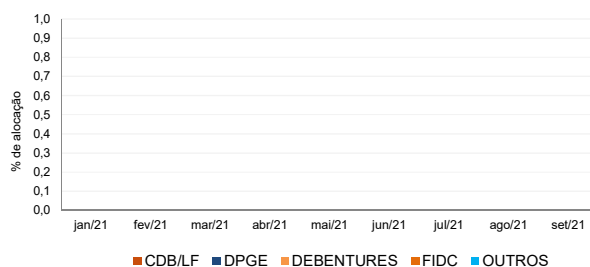
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 30/09/2021

## 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	3.062	0,04%	Selic	16-set-21	4,00%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	44.191	0,57%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	12.223	0,16%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	4.702	0,06%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	3.056	0,04%	Selic	16-set-21	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	10.159	0,13%	Selic	15-set-21	0,15%	0,15%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	9.143	0,12%	Selic	16-set-21	0,15%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	18.271	0,23%	Selic	01-set-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	16.241	0,21%	Selic	28-set-21	0,16%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	20.284	0,26%	Selic	01-set-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

