

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/01/2022

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>7.899.369,43</b>	<b>100%</b>				<b>1,13%</b>	<b>4,04%</b>	<b>8,40%</b>	<b>1,13%</b>	<b>15,65%</b>	<b>27,92%</b>	<b>41,24%</b>
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
<b>Renda Fixa ALM</b>	<b>7.116.482,19</b>	<b>90,11%</b>			<b>0,01%</b>							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.116.482,19	90,11%		100%	0,01%	1,20%	4,37%	9,26%	1,20%	17,42%	30,95%	45,86%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,90%	3,36%	7,94%	0,90%	15,23%	25,70%	36,75%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>782.887,24</b>	<b>9,91%</b>			<b>0,02%</b>							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	782.887,24	9,91%	BRADESCO	0,01%	0,02%	0,77%	2,13%	3,61%	0,77%	5,11%	7,53%	13,71%
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
<b>Total</b>	<b>7.897.729,69</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>	<b>1,13%</b>	<b>4,04%</b>	<b>8,40%</b>	<b>1,13%</b>	<b>15,65%</b>	<b>27,92%</b>	<b>41,24%</b>
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,90%	3,36%	7,94%	0,90%	15,23%	25,70%	36,75%

\* 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.

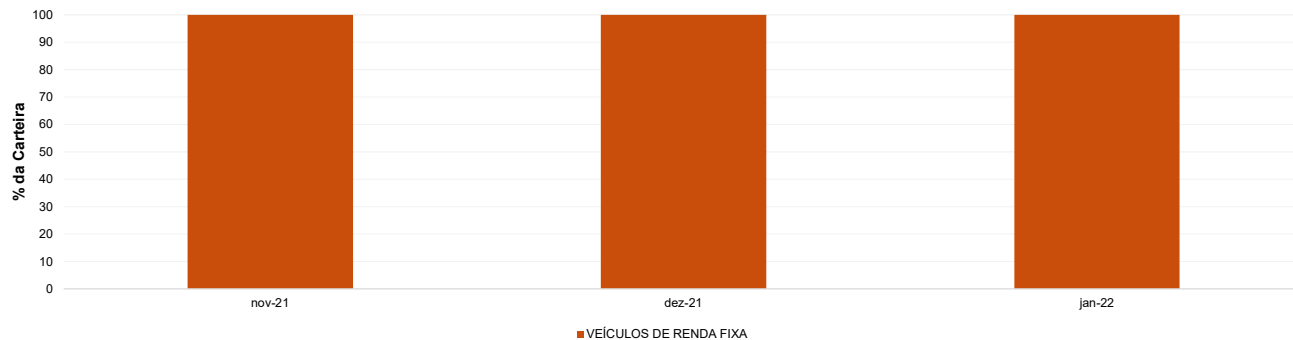
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

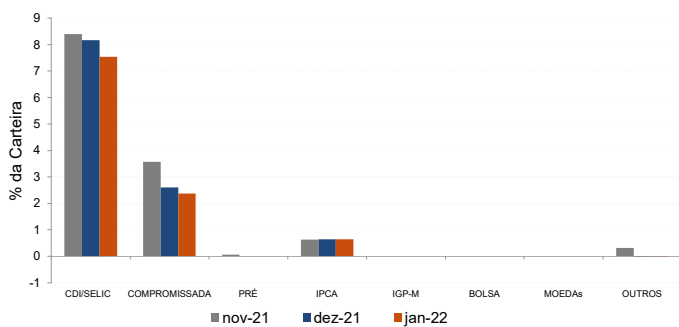
## Distribuição da Carteira

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.

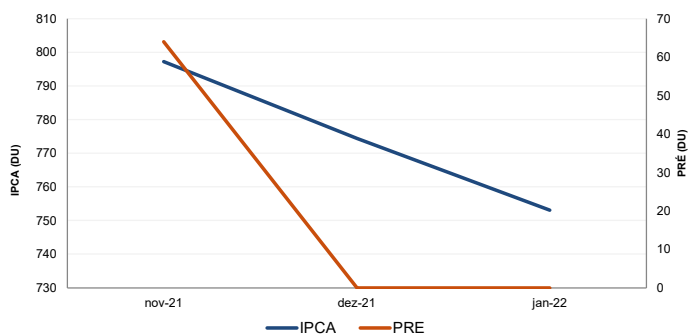
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/01/2022

## Análises de Contrapartes

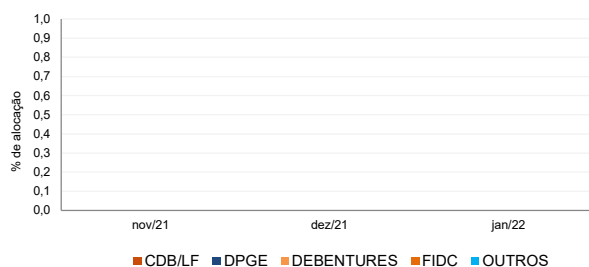
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/01/2022

## 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	7.206	0,09%	Selic	21-jan-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	6.990	0,09%	Selic	07-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.882	0,04%	Selic	11-jan-22	6,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.718	0,02%	Selic	21-jan-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	915	0,01%	Selic	14-jan-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	850	0,01%	Selic	04-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	14	0,00%	Selic	04-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	14.411	0,18%	Selic	31-jan-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.441	0,02%	Selic	06-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	721	0,01%	Selic	14-jan-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.522	0,03%	Selic	06-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	144	0,00%	Selic	07-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	7.201	0,09%	Selic	11-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.761	0,07%	Selic	12-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	28.770	0,36%	Selic	18-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	9.350	0,12%	Selic	14-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	7.192	0,09%	Selic	07-jan-22	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	7.192	0,09%	Selic	11-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.877	0,04%	Selic	06-jan-22	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	5.746	0,07%	Selic	14-jan-22	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	4.310	0,05%	Selic	14-jan-22	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	10.755	0,14%	Selic	31-jan-22	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	7.170	0,09%	Selic	13-jan-22	0,16%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.302	0,05%	Selic	14-jan-22	0,16%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.862	0,04%	Selic	21-jan-22	0,19%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

