

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 25/02/2022

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	8.330.551,64	100%				1,11%	3,53%	8,26%	2,25%	16,01%	28,66%	41,76%
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Renda Fixa ALM	7.051.455,45	84,66%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.051.455,45	84,66%		100%	0,01%	1,18%	3,77%	9,03%	2,39%	17,82%	31,73%	46,39%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,40%	8,03%	2,25%	15,42%	26,68%	37,51%
Renda Fixa CDI	1.279.096,19	15,36%			0,03%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.279.096,19	15,36%	BRADESCO	0,02%	0,03%	0,79%	2,34%	3,97%	1,57%	5,84%	8,08%	14,05%
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Total	8.329.086,01	100%			0,01%	1,11%	3,53%	8,26%	2,25%	16,01%	28,66%	41,76%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,40%	8,03%	2,25%	15,42%	26,68%	37,51%

* 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.

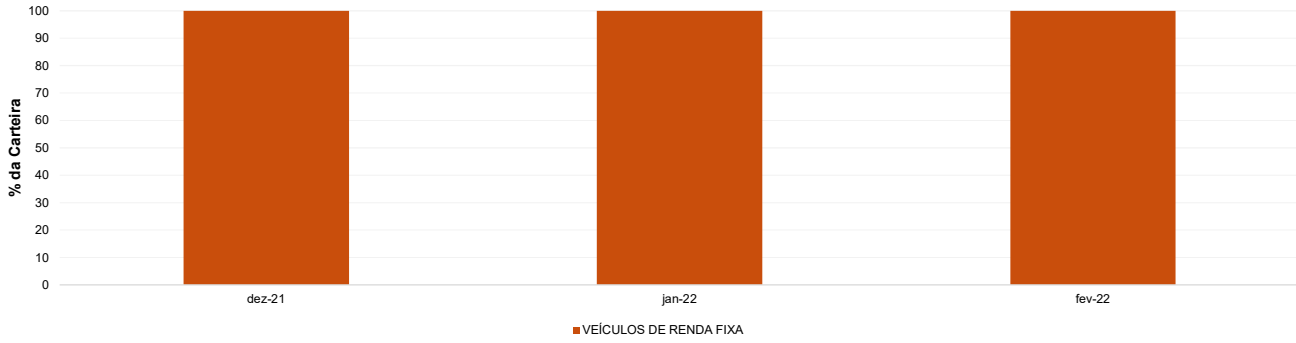
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

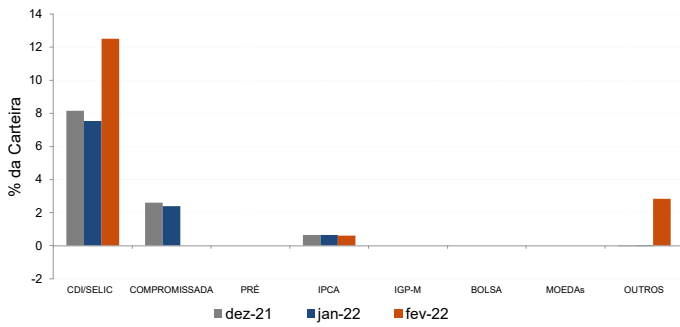
Distribuição da Carteira

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.

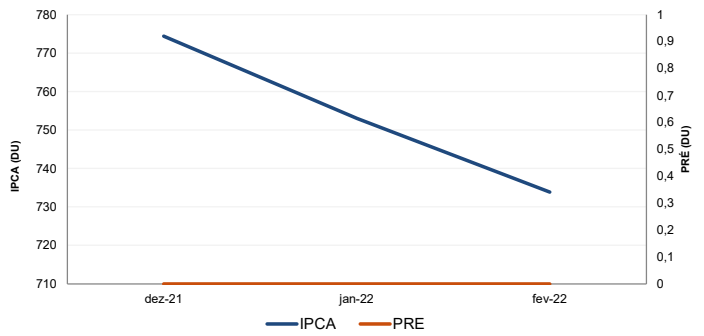
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 25/02/2022

Análises de Contrapartes

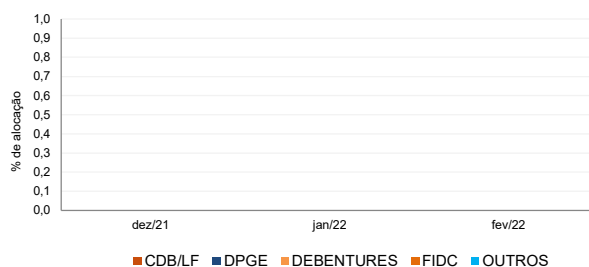
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 25/02/2022

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	20.536	0,25%	Selic	24-fev-22	0,15%	0,15%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	4.826	0,06%	Selic	07-fev-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.027	0,01%	Selic	07-fev-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	693	0,01%	Selic	07-fev-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	25.670	0,31%	Selic	14-fev-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	25.670	0,31%	Selic	15-fev-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	25.667	0,31%	Selic	23-fev-22	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.566	0,03%	Selic	23-fev-22	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	7.174	0,09%	Selic	02-fev-22	0,11%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

