

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2022

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
Renda Fixa	8.389.942,36	100%				1,69%	3,98%	8,45%	3,98%	16,00%	29,82%	42,82%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%
Renda Fixa ALM	7.656.052,48	91,24%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRK	7.656.052,48	91,24%		100%	0,01%	1,83%	4,26%	9,17%	4,26%	17,88%	33,04%	47,54%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					2,00%	4,30%	8,54%	4,30%	16,19%	28,64%	38,77%
Renda Fixa CDI	733.889,88	8,75%			0,03%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	733.889,88	8,75%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,92%	2,50%	4,44%	2,50%	6,60%	8,71%	14,56%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%
Total	8.390.904,72	100%			0,01%	1,69%	3,98%	8,45%	3,98%	16,00%	29,82%	42,82%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					2,00%	4,30%	8,54%	4,30%	16,19%	28,64%	38,77%

* 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.

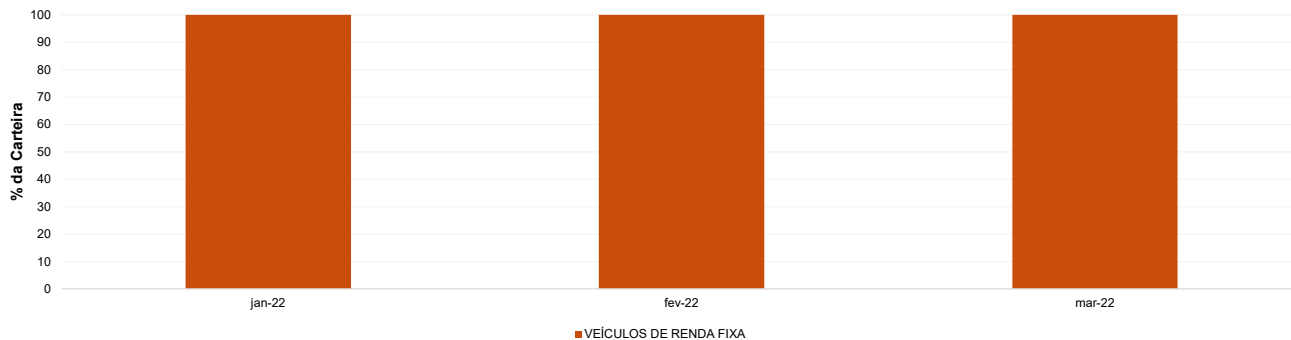
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

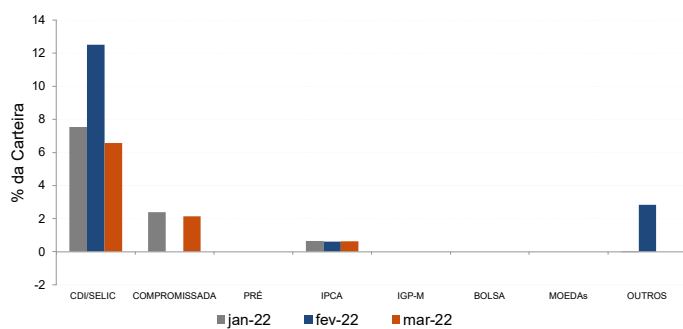
Distribuição da Carteira

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.

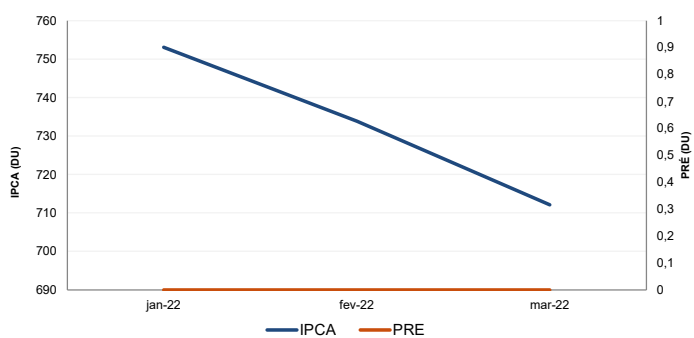
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2022

Análises de Contrapartes

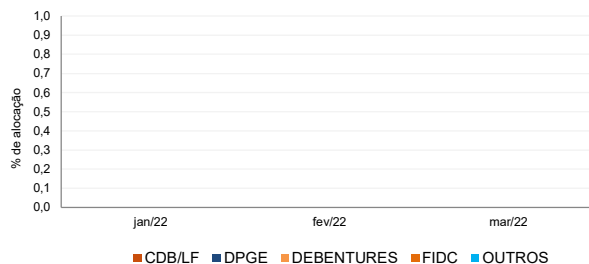
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2022

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 2022-09-01	01-set-22	29.317	0,35%	Selic	08-mar-22	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.173	0,01%	Selic	28-mar-22	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2.908	0,03%	Selic	11-mar-22	0,17%	0,17%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	31.863	0,38%	IPCA	21-mar-22	5,73%	5,74%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	19.939	0,24%	IPCA	21-mar-22	5,75%	5,76%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	28.431	0,34%	IPCA	21-mar-22	5,75%	5,77%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	39.984	0,48%	IPCA	21-mar-22	5,81%	5,82%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	89.184	1,06%	IPCA	21-mar-22	5,84%	5,86%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	100.096	1,19%	IPCA	21-mar-22	5,84%	5,87%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	166.770	1,98%	IPCA	21-mar-22	5,84%	5,86%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C

