

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/04/2022

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	8.741.307,72	100%				1,71%	4,58%	8,80%	5,76%	17,00%	31,51%	43,52%
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%
Renda Fixa ALM	7.795.662,88	89,20%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.795.662,88	89,20%		100%	0,01%	1,82%	4,91%	9,50%	6,16%	18,81%	34,89%	48,26%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,39%	4,80%	8,32%	5,75%	17,03%	30,39%	39,40%
Renda Fixa CDI	945.644,84	10,82%			0,09%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	945.644,84	10,82%	BRADESCO	0,02%	0,09%	0,74%	2,47%	4,65%	3,26%	7,23%	9,22%	14,82%
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%
Total	8.739.766,71	100%			0,01%	1,71%	4,58%	8,80%	5,76%	17,00%	31,51%	43,52%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,39%	4,80%	8,32%	5,75%	17,03%	30,39%	39,40%

* 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.

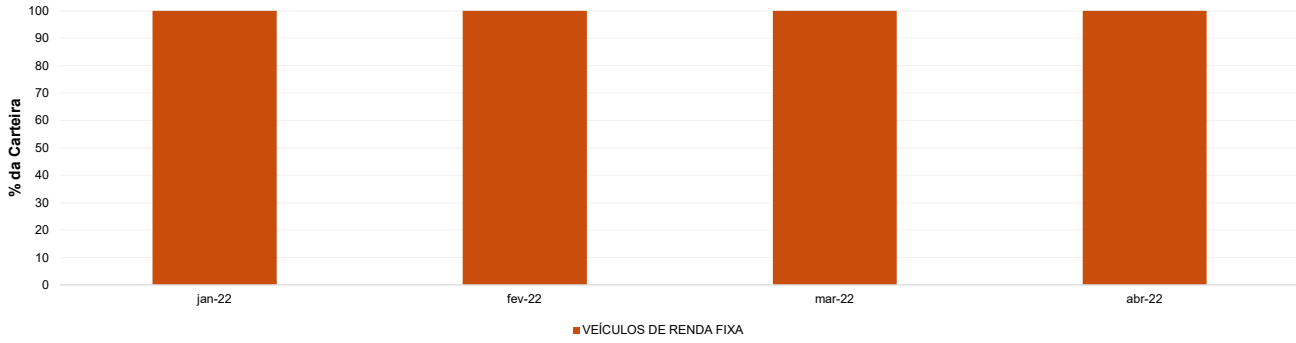
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

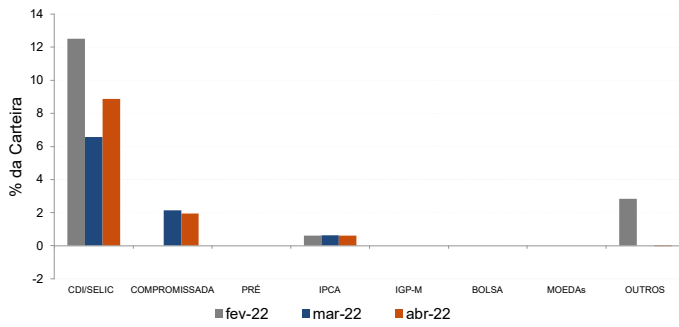
Distribuição da Carteira

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.

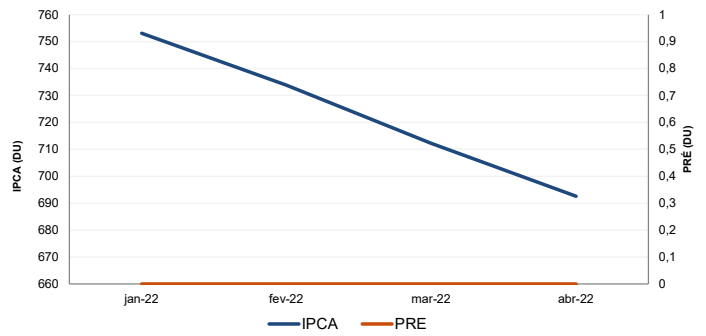
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/04/2022

Análises de Contrapartes

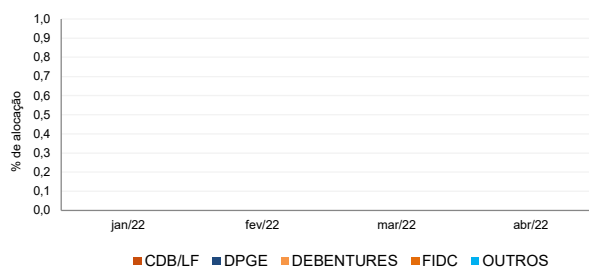
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/04/2022

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	4.475	0,05%	Selic	12-abr-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	11	0,00%	Selic	14-abr-22	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	15.647	0,18%	Selic	22-abr-22	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	11.153	0,13%	Selic	22-abr-22	0,12%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	11.132	0,13%	Selic	25-abr-22	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	11.118	0,13%	Selic	25-abr-22	0,16%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	5.782	0,07%	Selic	19-abr-22	0,14%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	4.434	0,05%	Selic	22-abr-22	0,21%	0,21%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

