

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2022

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	8.789.566,40	100%				1,45%	4,93%	8,63%	7,29%	17,60%	33,31%	44,32%
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Conservador Vitalício (ALM)	7.834.758,19	89,16%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.834.758,19	89,16%		100%	0,01%	1,51%	5,26%	9,22%	7,77%	19,35%	36,80%	49,07%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,85%	4,29%	7,84%	6,64%	16,64%	31,54%	39,87%
Conservador Vitalício (Fundo)	954.808,21	10,87%			0,08%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	954.808,21	10,87%	BRABESCO	0,02%	0,08%	1,06%	2,74%	5,14%	4,35%	8,06%	10,12%	15,41%
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Total	8.787.652,42	100%			0,01%	1,45%	4,93%	8,63%	7,29%	17,60%	33,31%	44,32%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,85%	4,29%	7,84%	6,64%	16,64%	31,54%	39,87%

* 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.

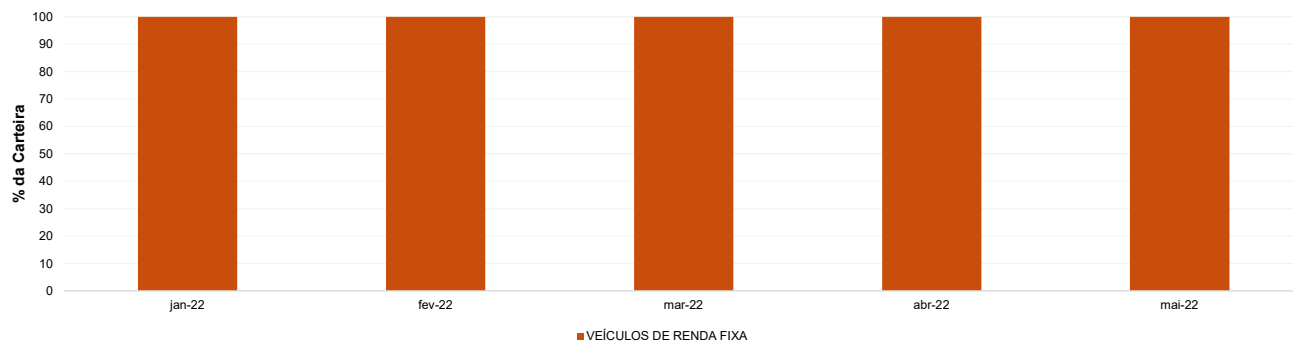
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

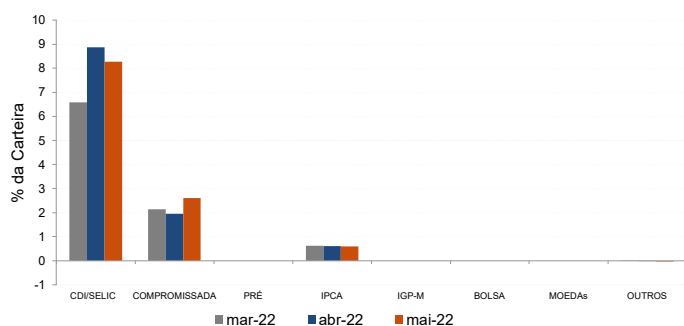
Distribuição da Carteira

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.

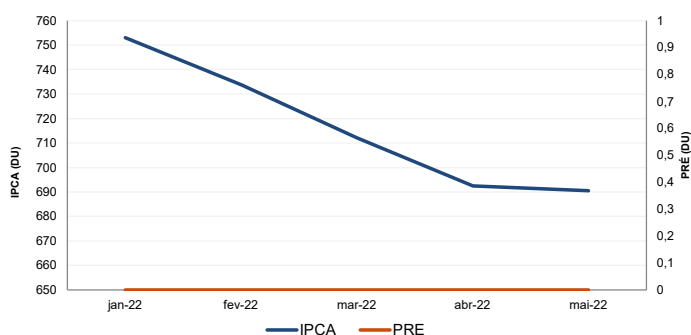
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2022

Análises de Contrapartes

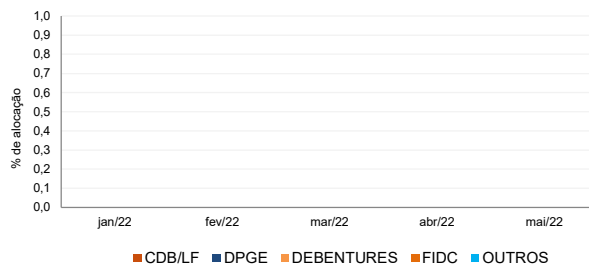
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2022

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	8.249	0,09%	Selic	16-mai-22	4,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	5.539	0,06%	Selic	19-mai-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.663	0,03%	Selic	10-mai-22	5,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.498	0,03%	Selic	16-mai-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.885	0,07%	Selic	19-mai-22	0,09%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

