

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/07/2022

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	8.775.487,00	100%				0,56%	3,06%	7,78%	9,00%	16,83%	33,58%	44,96%
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Conservador Vitalício (ALM)	7.959.114,55	90,72%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.959.114,55	90,72%		100%	0,01%	0,53%	3,13%	8,19%	9,48%	18,21%	36,97%	49,58%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					-0,32%	1,56%	6,43%	7,39%	14,88%	30,67%	39,57%
Conservador Vitalício (Fundo)	816.372,45	9,30%			0,05%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	816.372,45	9,30%	BRADESCO	0,02%	0,05%	1,05%	3,17%	5,72%	6,54%	9,54%	11,97%	16,62%
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Total	8.773.652,48	100%			0,01%	0,56%	3,06%	7,78%	9,00%	16,83%	33,58%	44,96%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					-0,32%	1,56%	6,43%	7,39%	14,88%	30,67%	39,57%

* 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.

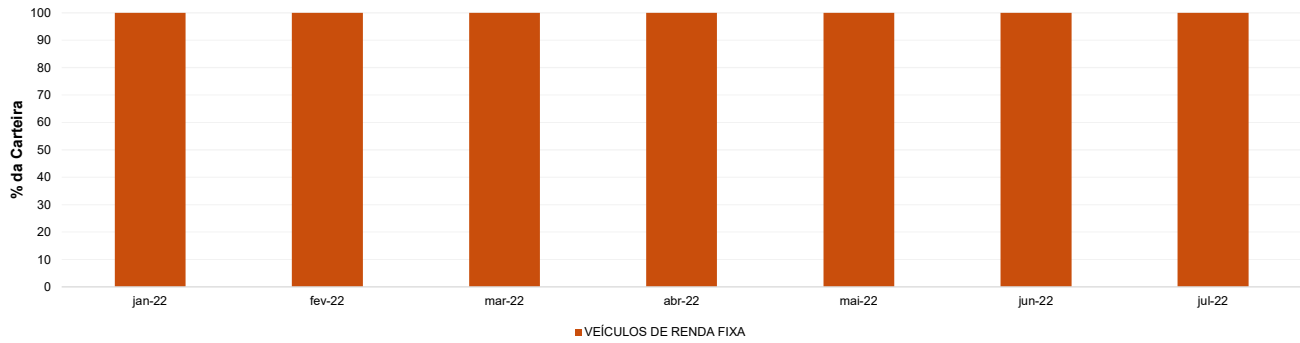
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

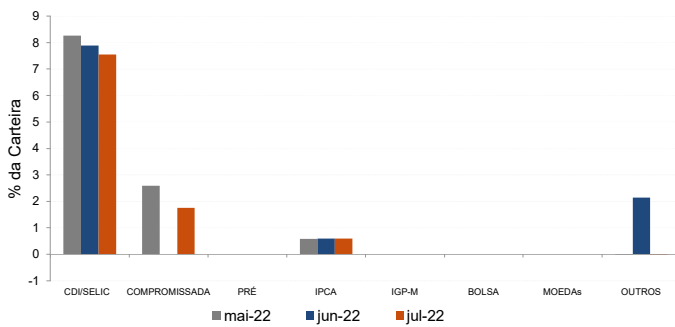
Distribuição da Carteira

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.

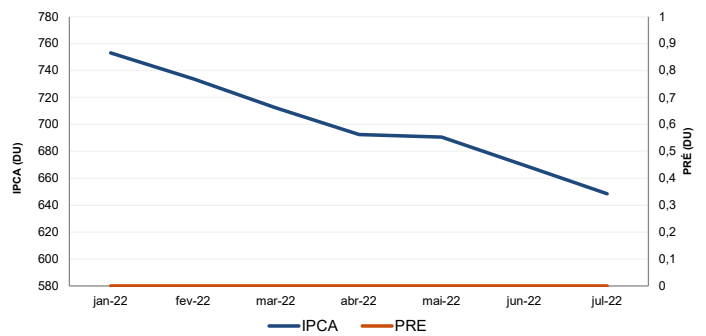
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/07/2022

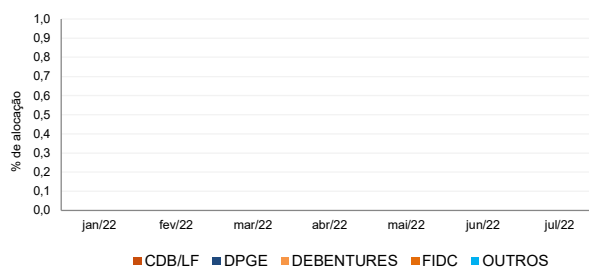
Análises de Contrapartes

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
------	------	---	---------------------------

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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: 29/07/2022

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	17.677	0,20%	Selic	25-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	7.933	0,09%	Selic	04-jul-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	5.666	0,06%	Selic	25-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	4.513	0,05%	Selic	25-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.587	0,02%	Selic	04-jul-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.587	0,02%	Selic	04-jul-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	907	0,01%	Selic	25-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	113	0,00%	Selic	20-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	82	0,00%	Selic	25-jul-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.533	0,05%	Selic	28-jul-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	4.526	0,05%	Selic	14-jul-22	0,08%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	3.392	0,04%	Selic	28-jul-22	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.388	0,04%	Selic	14-jul-22	0,11%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	4.499	0,05%	Selic	12-jul-22	0,16%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

