

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2022

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	8.711.667,53	100%			0,14%	1,73%	6,74%	9,15%	15,56%	32,75%	44,20%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Conservador Vitalício (ALM)	7.499.579,88	86,11%		0,02%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.499.579,88	86,11%	100%	0,02%	0,03%	1,62%	6,96%	9,52%	16,62%	35,90%	48,57%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,03%	0,74%	5,06%	7,43%	13,50%	29,93%	38,94%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.212.087,65	13,92%		0,02%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.212.087,65	13,92%	BRABESCO	0,03%	1,19%	3,31%	6,14%	7,80%	10,35%	13,13%	17,42%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Total	8.709.690,00	100%		0,01%	0,14%	1,73%	6,74%	9,15%	15,56%	32,75%	44,20%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,03%	0,74%	5,06%	7,43%	13,50%	29,93%	38,94%

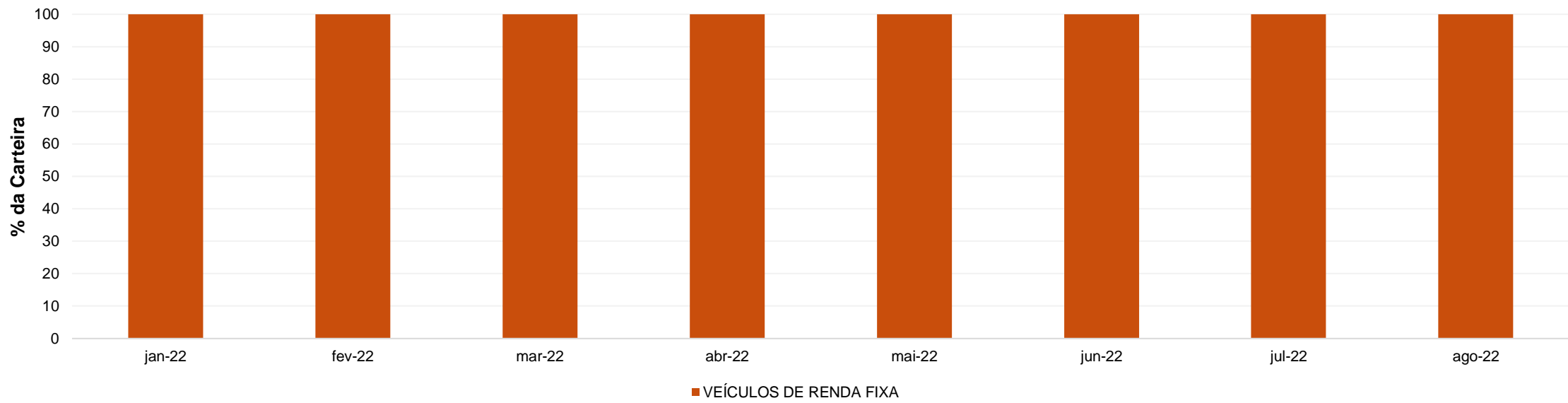
* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC. O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este 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.

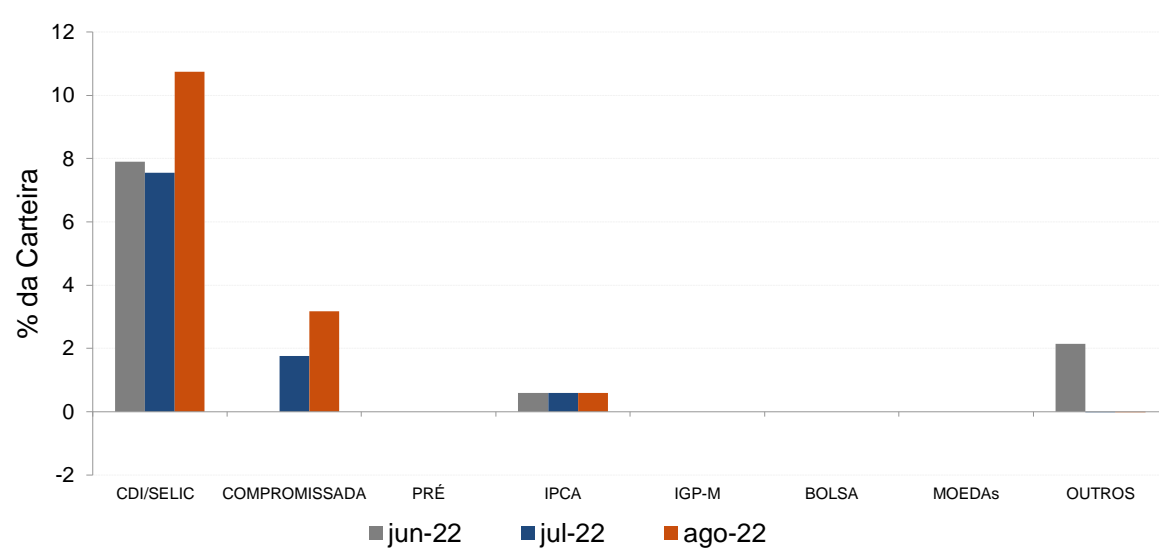
Distribuição da Carteira

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.

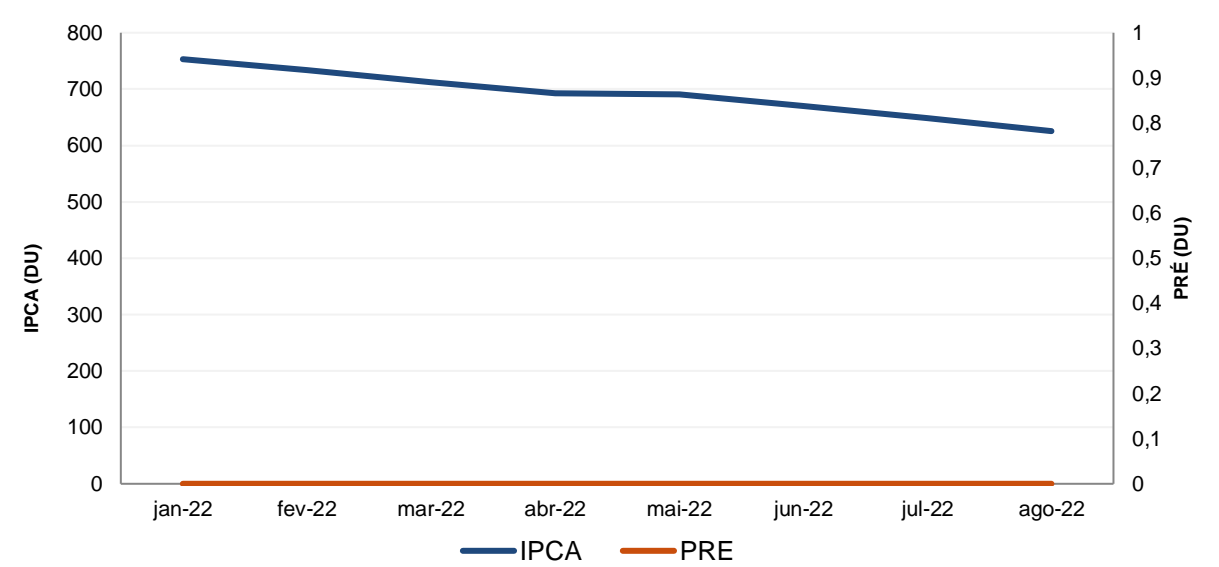
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2022

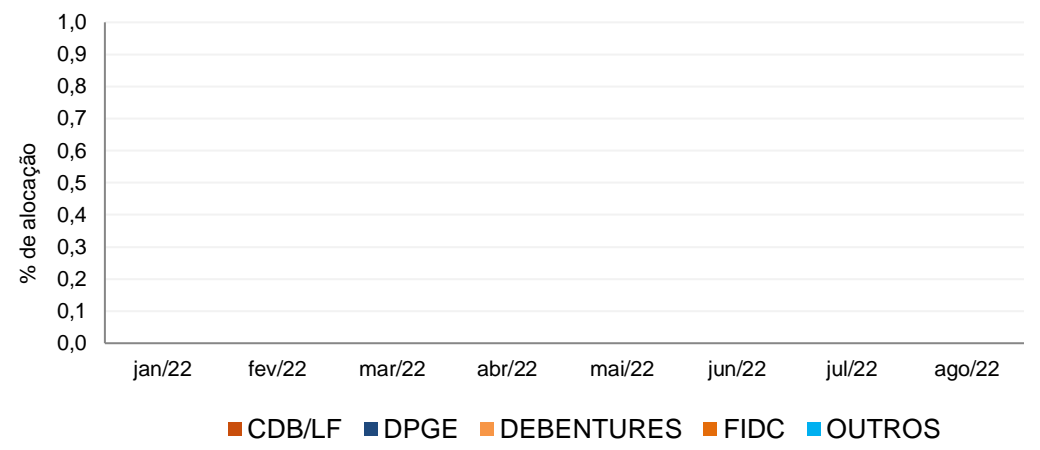
Análises de Contrapartes

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.								



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 2023-03-01	01-mar-23	11.450	0,13%	Selic	31-ago-22	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	7.633	0,09%	Selic	31-ago-22	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	7.633	0,09%	Selic	11-ago-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	9.922	0,11%	Selic	29-ago-22	0,02%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	7.630	0,09%	Selic	05-ago-22	5,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	19.047	0,22%	Selic	02-ago-22	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	18.999	0,22%	Selic	02-ago-22	0,13%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	18.937	0,22%	Selic	02-ago-22	0,17%	0,17%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	9.468	0,11%	Selic	09-ago-22	0,18%	0,18%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

