

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2022

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	8.645.374,77	100%				0,65%	1,07%	4,17%	10,17%	13,34%	31,23%	43,93%
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
Conservador Vitalício (ALM)	7.559.687,58	87,46%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.559.687,58	87,46%		100%	0,01%	1,05%	1,27%	4,44%	10,87%	14,36%	34,47%	48,62%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,93%	1,03%	2,61%	8,50%	11,14%	28,36%	39,20%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.085.687,19	12,56%			0,01%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.085.687,19	12,56%	BRADESCO	0,03%	0,01%	1,03%	3,35%	6,63%	10,10%	11,59%	15,42%	18,81%
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
Total	8.643.621,36	100%			0,01%	0,65%	1,07%	4,17%	10,17%	13,34%	31,23%	43,93%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,93%	1,03%	2,61%	8,50%	11,14%	28,36%	39,20%

* 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.

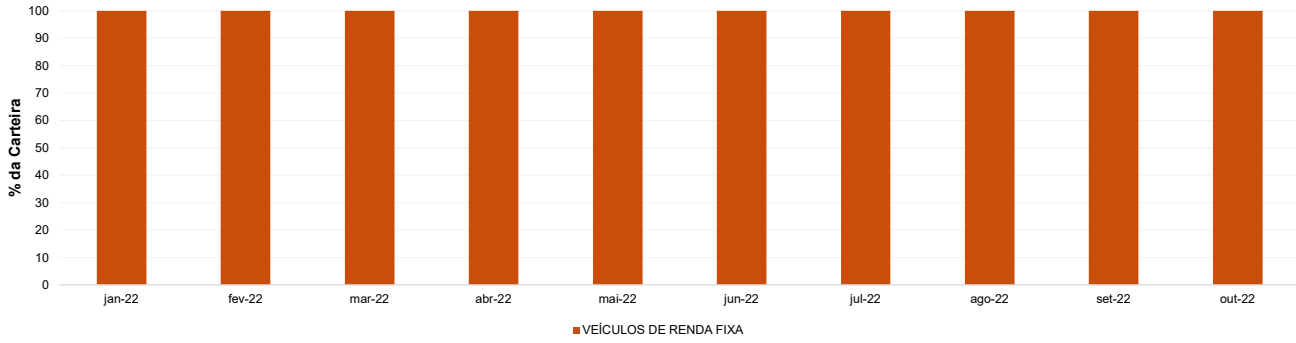
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

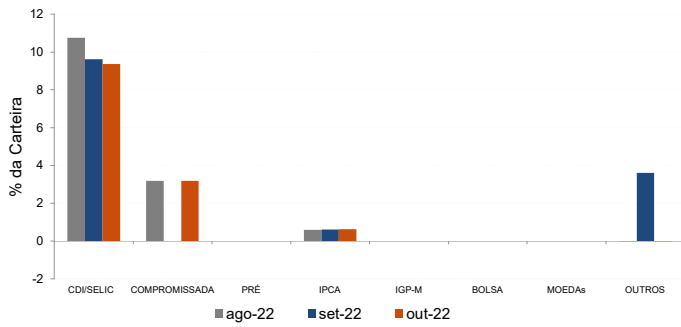
Distribuição da Carteira

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.

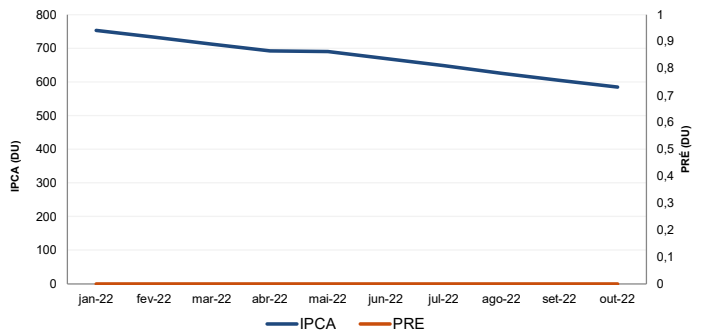
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2022

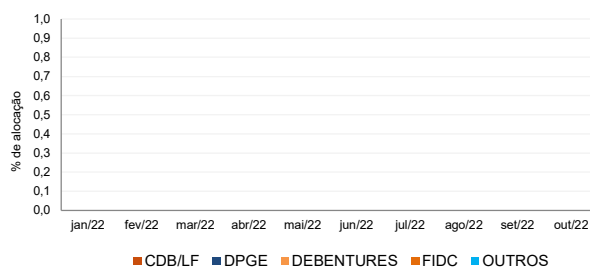
Análises de Contrapartes

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: 31/10/2022

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 2023-09-01	01-set-23	6.882	0,08%	Selic	31-out-22	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	6.881	0,08%	Selic	31-out-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	6.000	0,07%	Selic	27-out-22	0,10%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	4.788	0,06%	Selic	27-out-22	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

