

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/12/2022

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	8.894.700,78	100%				0,93%	2,70%	3,71%	12,41%	12,41%	30,15%	43,98%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Conservador Vitalício (ALM)	7.635.598,92	85,86%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	7.635.598,92	85,86%		100%	0,01%	1,01%	2,33%	3,10%	12,28%	12,28%	32,09%	47,28%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,00%	2,71%	2,48%	10,41%	10,41%	26,83%	38,36%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.259.101,86	14,16%			0,02%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.259.101,86	14,16%	BRADESCO	0,04%	0,02%	1,13%	3,20%	6,67%	12,47%	12,47%	17,50%	20,46%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Total	8.892.720,48	100%			0,01%	0,93%	2,70%	3,71%	12,41%	12,41%	30,15%	43,98%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,00%	2,71%	2,48%	10,41%	10,41%	26,83%	38,36%

* 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.

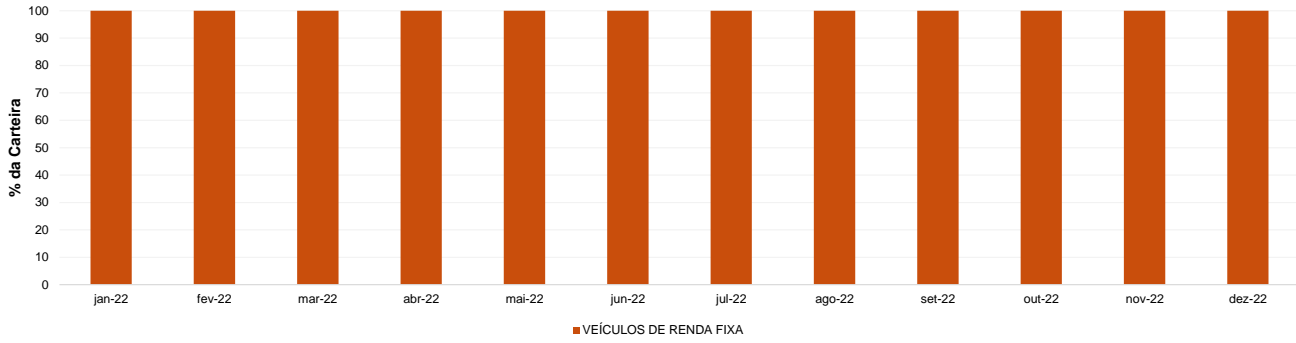
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

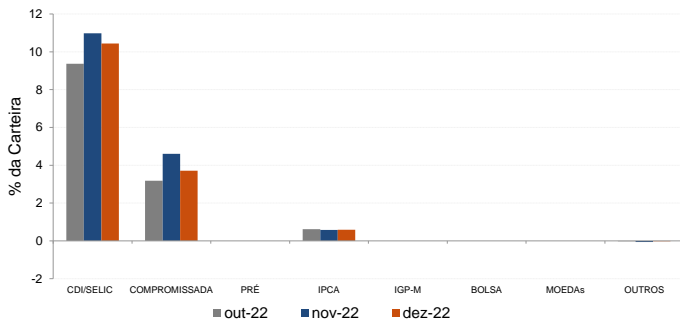
Distribuição da Carteira

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.

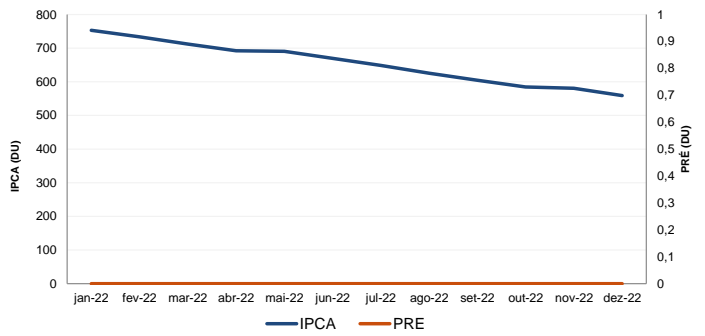
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/12/2022

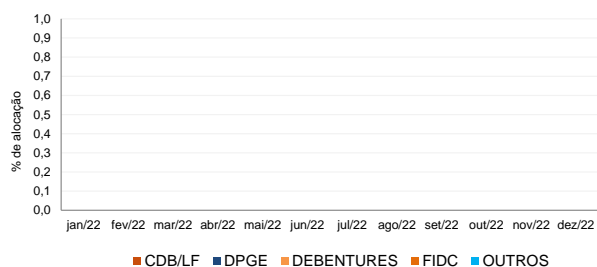
Análises de Contrapartes

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: 30/12/2022

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 2023-03-01	01-mar-23	13.715	0,15%	Selic	27-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.659	0,04%	Selic	27-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	13.720	0,15%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	11.433	0,13%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	274	0,00%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	22.866	0,26%	Selic	28-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.829	0,02%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	22.895	0,26%	Selic	28-dez-22	0,03%	0,03%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	45.663	0,51%	Selic	28-dez-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-09-01	01-set-27	22.681	0,25%	Selic	28-dez-22	0,18%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-09-01	01-set-27	11.340	0,13%	Selic	07-dez-22	0,16%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

