

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2023

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	8.930.439,36	100%				0,98%	3,16%	5,26%	2,20%	12,36%	30,35%	44,56%
Benchmark:	CDI					0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%
Conservador Vitalício (ALM)	7.655.221,23	85,74%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.655.221,23	85,74%		100%	0,01%	1,03%	3,32%	4,87%	2,29%	12,17%	32,16%	47,77%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,15%	3,09%	4,90%	2,07%	10,21%	27,20%	39,62%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.275.218,13	14,28%			0,01%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.275.218,13	14,28%	BRADESCO	0,04%	0,01%	0,93%	3,21%	6,48%	2,06%	13,02%	19,61%	22,15%
Benchmark:	CDI					0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%
Total	8.928.803,95	100%			0,01%	0,98%	3,16%	5,26%	2,20%	12,36%	30,35%	44,56%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,15%	3,09%	4,90%	2,07%	10,21%	27,20%	39,62%

* 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.

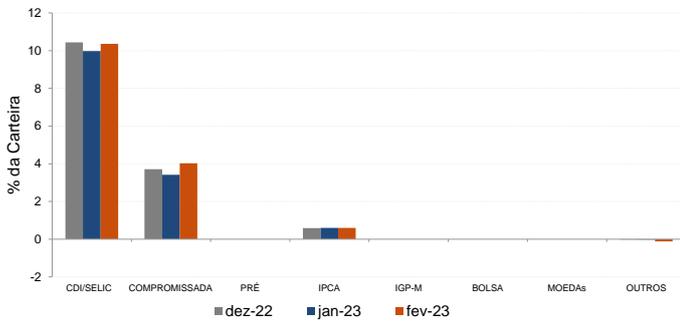
Distribuição da Carteira

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.

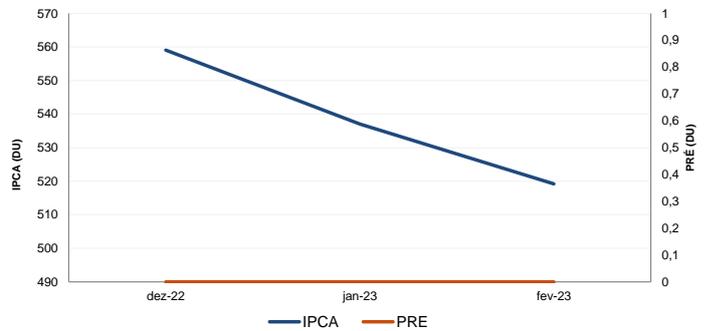
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2023

Análises de Contrapartes

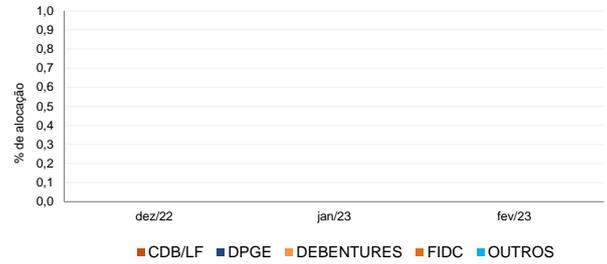
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 28/02/2023

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. Nenhuma operação feita no último mês.