

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2023

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>8.979.757,67</b>	<b>100%</b>				<b>1,47%</b>	<b>3,71%</b>	<b>6,51%</b>	<b>3,71%</b>	<b>12,11%</b>	<b>30,05%</b>	<b>45,55%</b>
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,55%	3,25%	13,28%	20,54%	23,23%
<b>Conservador Vitalício (ALM)</b>	<b>7.773.480,85</b>	<b>86,59%</b>			<b>0,00%</b>							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	7.773.480,85	86,59%		100%	0,00%	1,48%	3,80%	6,22%	3,80%	11,78%	31,77%	48,72%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,11%	3,20%	5,99%	3,20%	9,24%	26,93%	40,53%
<b>Conservador Vitalício (Fundo)</b>	<b>1.206.276,82</b>	<b>13,44%</b>			<b>0,02%</b>							
BRAM FIR F REF. DI FEDERAL II	1.206.276,82	13,44%	BRADESCO	0,03%	0,02%	1,17%	3,25%	6,56%	3,25%	13,29%	20,78%	23,17%
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,55%	3,25%	13,28%	20,54%	23,23%
<b>Total</b>	<b>8.977.674,52</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>	<b>1,47%</b>	<b>3,71%</b>	<b>6,51%</b>	<b>3,71%</b>	<b>12,11%</b>	<b>30,05%</b>	<b>45,55%</b>
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,11%	3,20%	5,99%	3,20%	9,24%	26,93%	40,53%

\* 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.

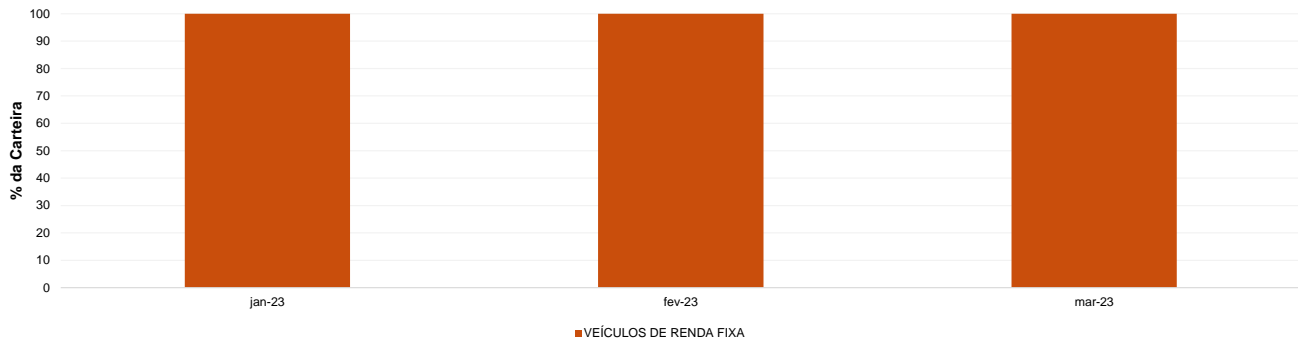
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

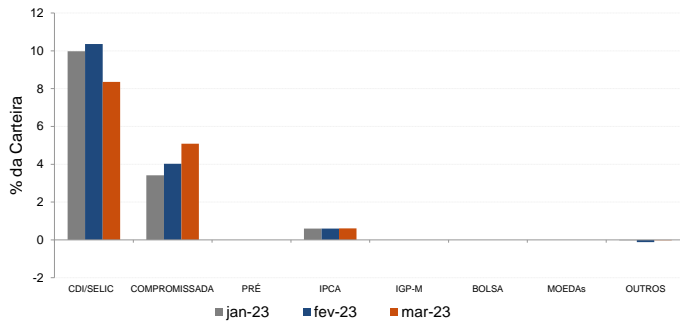
## Distribuição da Carteira

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.

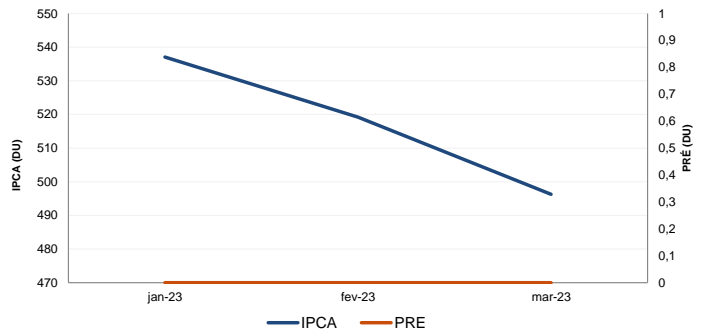
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/03/2023

## Análises de Contrapartes

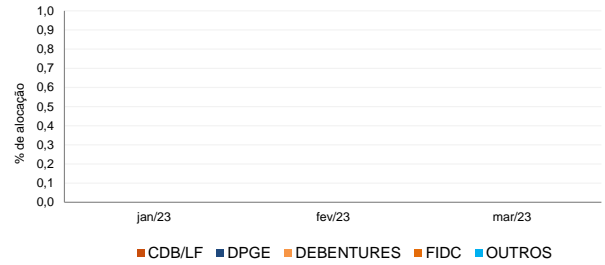
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2023

## 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.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	20.802	0,23%	Selic	29-mar-23	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.601	0,06%	Selic	29-mar-23	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	20.000	0,22%	Selic	13-mar-23	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.760	0,03%	Selic	20-mar-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.240	0,02%	Selic	07-mar-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	39.998	0,45%	Selic	29-mar-23	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	19.993	0,22%	Selic	03-mar-23	0,02%	0,03%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	19.993	0,22%	Selic	13-mar-23	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	17.836	0,20%	Selic	29-mar-23	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	6.383	0,07%	Selic	29-mar-23	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.352	0,05%	Selic	29-mar-23	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	3.343	0,04%	Selic	29-mar-23	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	19.932	0,22%	Selic	13-mar-23	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-09-01	01-set-27	19.864	0,22%	Selic	13-mar-23	0,13%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II