

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2023

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	9,199,437.76	100%				0.80%	1.92%	6.83%	9.19%	12.45%	29.95%	49.28%
Benchmark:	CDI					1.14%	3.32%	6.68%	8.87%	13.55%	25.14%	28.52%
Conservador Vitalício (ALM)	8,065,702.42	87.70%			0.00%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	8,065,702.42	87.70%		100%	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0.62%	1.39%	4.08%	6.23%	9.18%	23.92%	41.86%
Conservador Vitalício (Fundo)	1,133,735.34	12.33%			0.02%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1,133,735.34	12.33%	BRADESCO	0.04%	0.02%	1.16%	3.34%	6.69%	8.89%	13.60%	25.36%	28.51%
Benchmark:	CDI					1.14%	3.32%	6.68%	8.87%	13.55%	25.14%	28.52%
Total	9,197,297.26	100%			0.01%	0.80%	1.92%	6.83%	9.19%	12.45%	29.95%	49.28%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0.62%	1.39%	4.08%	6.23%	9.18%	23.92%	41.86%

* 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.

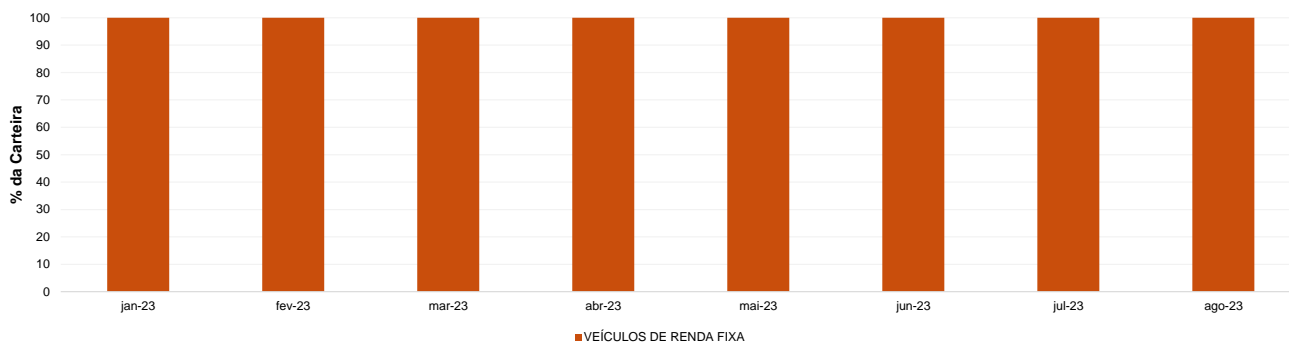
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

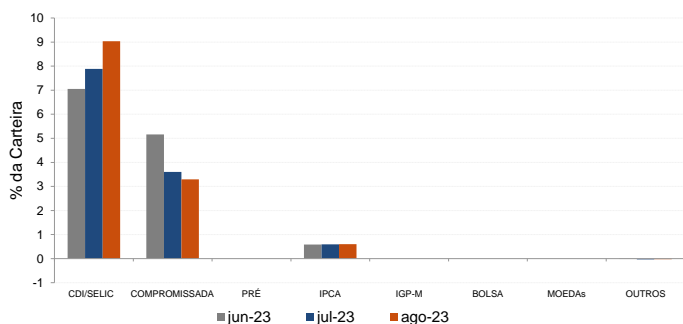
Distribuição da Carteira

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.

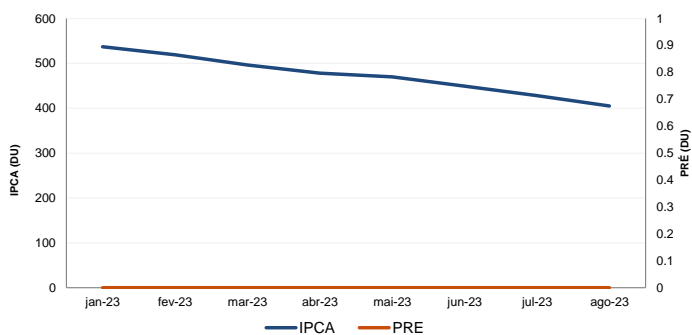
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2023

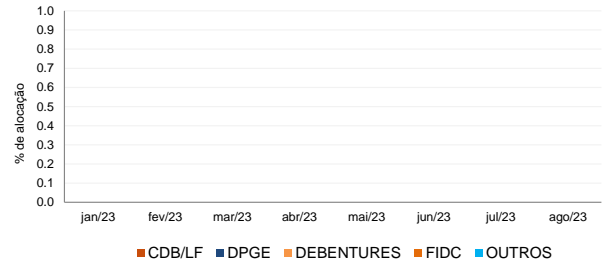
Análises de Contrapartes

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
------	------	---	---------------------------

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: 31/08/2023

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	12,118	0.13%	Selic	07-ago-23	5.00%	0.05%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	9,088	0.10%	Selic	07-ago-23	5.00%	0.05%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	12,118	0.13%	Selic	01-ago-23	0.01%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	8,361	0.09%	Selic	30-ago-23	0.00%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6,059	0.07%	Selic	30-ago-23	0.00%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3,756	0.04%	Selic	30-ago-23	0.00%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	606	0.01%	Selic	01-ago-23	0.01%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	12,070	0.13%	Selic	03-ago-23	0.12%	0.12%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-09-01	01-set-27	6,028	0.07%	Selic	03-ago-23	0.14%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

