

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2023

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	9.207.030,46	100%				0,56%	3,45%	7,03%	8,32%	11,71%	30,52%	49,23%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Conservador Vitalício (ALM)	8.150.353,95	88,54%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	8.150.353,95	88,54%		100%	0,01%	1,05%	3,32%	6,56%	7,89%	10,65%	30,80%	51,56%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,48%	1,37%	4,62%	5,57%	8,54%	24,69%	41,83%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.056.676,51	11,48%			0,02%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.056.676,51	11,48%	BRADESCO	0,04%	0,02%	1,06%	3,33%	6,44%	7,64%	13,64%	24,47%	27,24%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Total	9.205.060,56	100%			0,01%	0,56%	3,45%	7,03%	8,32%	11,71%	30,52%	49,23%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,48%	1,37%	4,62%	5,57%	8,54%	24,69%	41,83%

* 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.

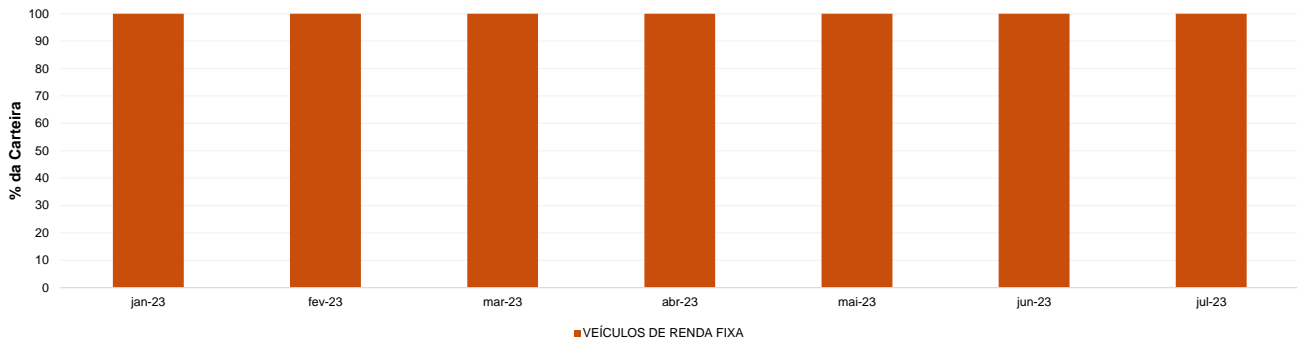
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

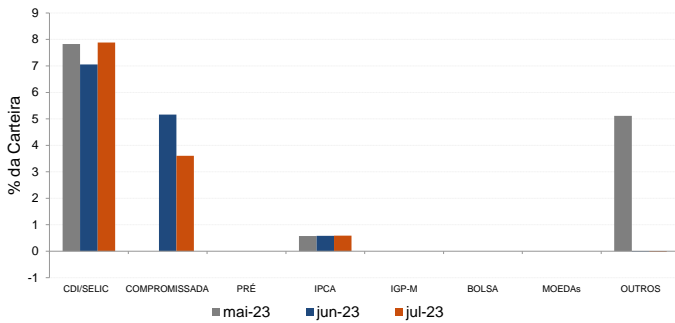
Distribuição da Carteira

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.

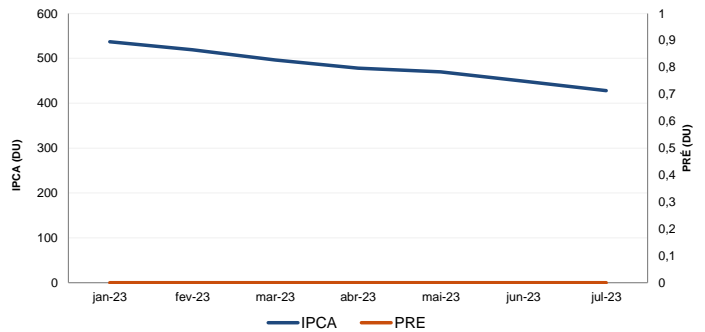
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2023

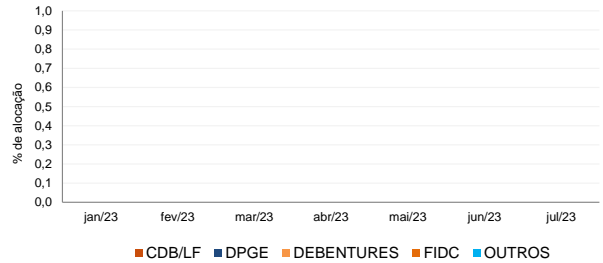
Análises de Contrapartes

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: 31/07/2023

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 2024-03-01	01-mar-24	7.717	0,08%	Selic	14-jul-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

