

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2023

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	9,237,085.09	100%			0.55%	3.87%	7.72%	7.72%	11.71%	31.23%	49.71%	
Benchmark:	CDI				1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
Conservador Vitalício (ALM)	8,108,600.91	87.80%		0.01%								
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	8,108,600.91	87.80%		100%	0.01%	1.17%	2.86%	6.77%	6.77%	10.08%	31.06%	51.38%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0.28%	1.81%	5.07%	5.07%	7.67%	25.76%	42.21%
Conservador Vitalício (Fundo)	1,128,484.18	12.22%		0.03%								
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1,128,484.18	12.22%	BRADESCO	0.04%	0.03%	1.09%	3.16%	6.51%	6.51%	13.62%	23.65%	26.15%
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%
Total	9,235,117.31	100%			0.01%	0.55%	3.87%	7.72%	7.72%	11.71%	31.23%	49.71%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0.28%	1.81%	5.07%	5.07%	7.67%	25.76%	42.21%

* 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.

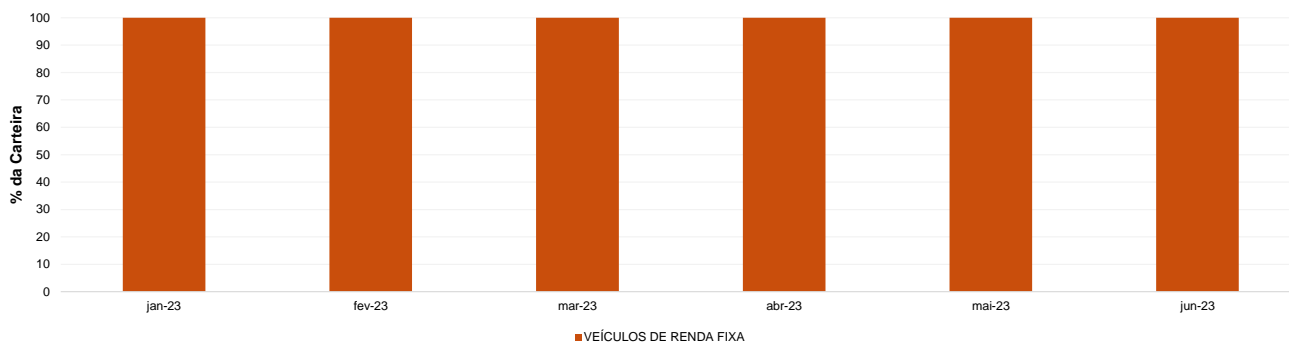
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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

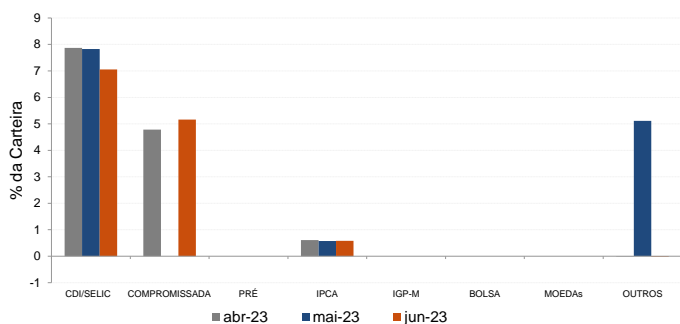
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

Evolução do Patrimônio Líquido

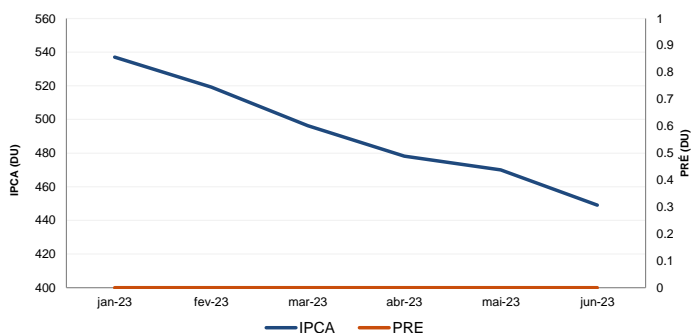


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/06/2023

Análises de Contrapartes

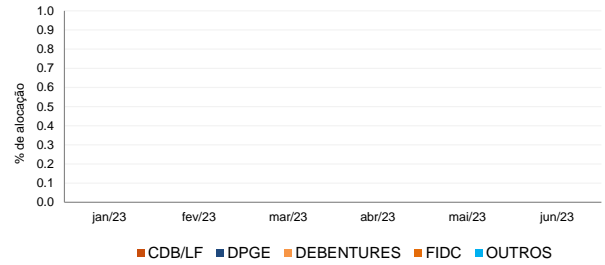
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MM*	%	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: 30/06/2023

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 2025-03-01	01-mar-25	36,172	0.39%	Selic	29-jun-23	0.01%	0.01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	3,858	0.04%	Selic	28-jun-23	0.02%	0.02%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	48,149	0.52%	Selic	01-jun-23	0.08%	0.00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

