

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2023

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
Renda Fixa	9.268.488,81	100%				2,31%	4,82%	8,13%	7,13%	12,24%	32,00%	49,63%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Conservador Vitalício (ALM)	8.068.157,80	87,07%			0,01%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	8.068.157,80	87,07%		100%	0,01%	1,07%	3,18%	6,60%	5,54%	9,95%	31,22%	50,42%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,61%	2,65%	5,82%	4,78%	8,48%	26,53%	42,70%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.200.331,01	12,95%			0,03%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.200.331,01	12,95%	BRADESCO	0,04%	0,03%	1,14%	3,24%	6,55%	5,36%	13,56%	22,71%	25,05%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Total	9.266.438,51	100%			0,01%	2,31%	4,82%	8,13%	7,13%	12,24%	32,00%	49,63%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,61%	2,65%	5,82%	4,78%	8,48%	26,53%	42,70%

* 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.

Esse 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.

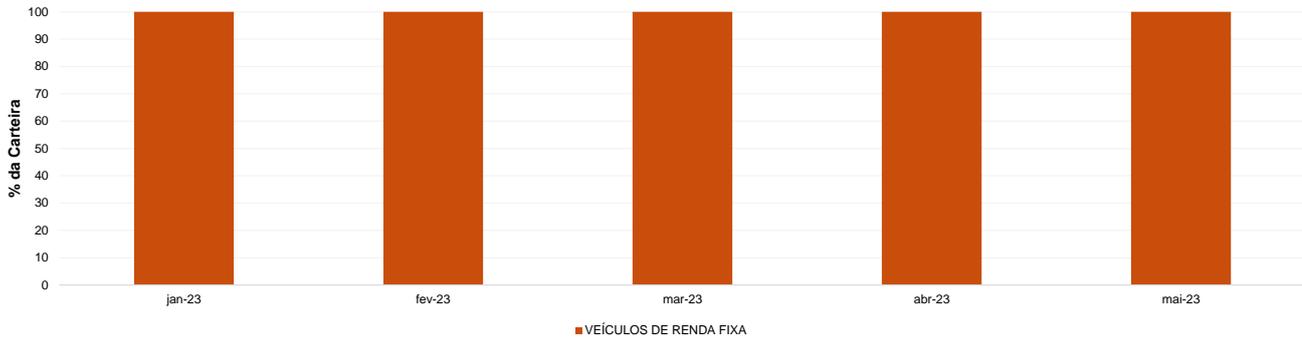
RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2023

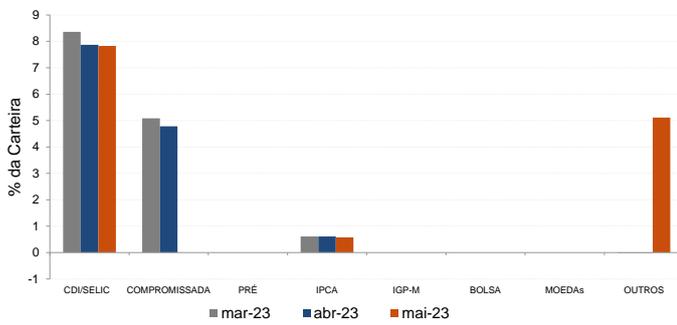
Distribuição da Carteira

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.

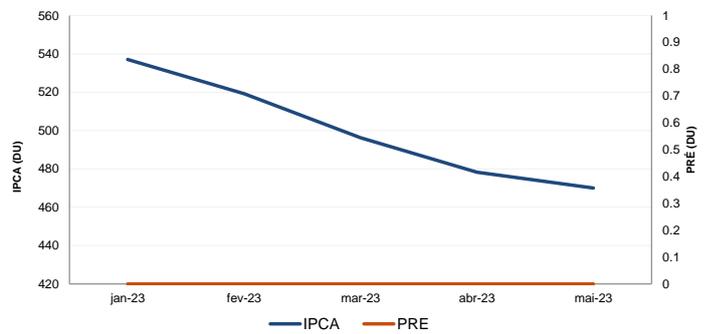
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2023

Análises de Contrapartes

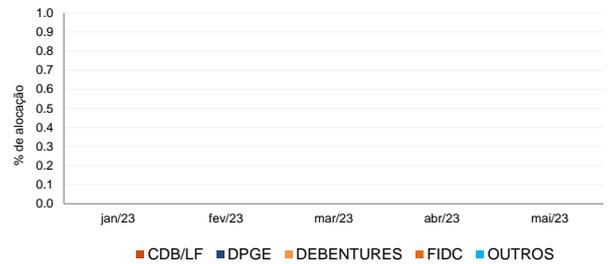
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2023

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	7.629	0,08%	Selic	30-mai-23	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	19.420	0,21%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	7.771	0,08%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2027-09-01	01-set-27	21.657	0,23%	Selic	16-mai-23	0,16%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	812.186	8,77%	IPCA	10-mai-23	5,84%	0,00%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	524.459	5,66%	IPCA	10-mai-23	5,96%	5,96%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	515.482	5,57%	IPCA	10-mai-23	5,96%	5,96%	RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO C

