

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2023

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	9.158.727,91	100%				0,73%	2,24%	4,21%	11,63%	12,67%	27,06%	47,66%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,92%	6,33%	12,04%	13,30%	26,87%	31,66%
Conservador Vitalício (ALM)	8.150.197,53	89,01%			0,00%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	8.150.197,53	89,01%		100%	0,00%	1,63%	3,14%	6,64%	12,55%	13,68%	28,07%	51,25%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,62%	1,84%	3,25%	8,18%	9,26%	20,79%	39,58%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.008.530,38	11,01%			0,02%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.008.530,38	11,01%	BRADESCO	0,03%	0,02%	0,90%	2,90%	6,34%	12,04%	13,30%	26,97%	31,94%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,92%	6,33%	12,04%	13,30%	26,87%	31,66%
Total	9.156.869,01	100%			0,00%	0,73%	2,24%	4,21%	11,63%	12,67%	27,06%	47,66%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,62%	1,84%	3,25%	8,18%	9,26%	20,79%	39,58%

* 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.

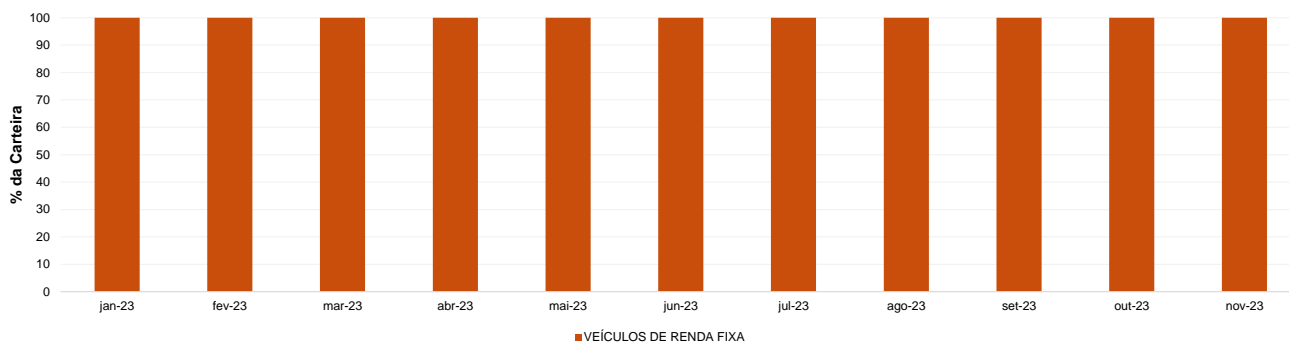
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

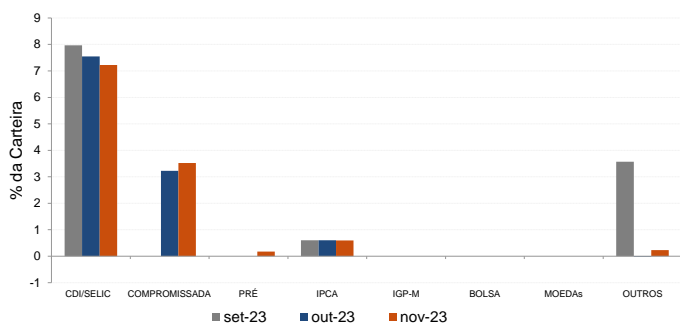
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais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

Evolução do Patrimônio Líquido

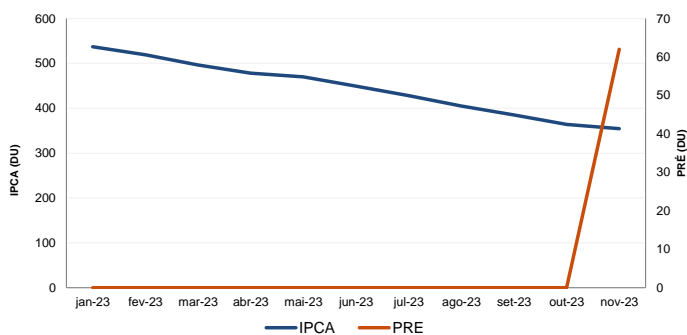


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2023

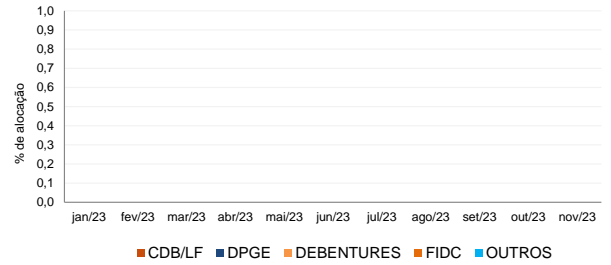
Análises de Contrapartes

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: 30/11/2023

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	48.020	0,52%	Selic	23-nov-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	12.005	0,13%	Selic	29-nov-23	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	24.003	0,26%	Selic	23-nov-23	0,01%	0,02%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	29.946	0,33%	Selic	09-nov-23	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

