

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/09/2023

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	9.186.032,57	100%				0,74%	2,12%	6,07%	10,00%	12,97%	28,97%	49,13%
Benchmark:	CDI					0,97%	3,22%	6,47%	9,93%	13,44%	25,80%	29,57%
Conservador Vitalício (ALM)	8.124.861,88	88,47%			0,00%							
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	8.124.861,88	88,47%		100%	0,00%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,60%	1,72%	3,56%	6,87%	9,77%	22,80%	41,30%
Conservador Vitalício (Fundo)	1.061.170,69	11,55%			0,01%							
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.061.170,69	11,55%	BRADESCO	0,04%	0,01%	0,98%	3,23%	6,49%	9,95%	13,48%	26,00%	29,78%
Benchmark:	CDI					0,97%	3,22%	6,47%	9,93%	13,44%	25,80%	29,57%
Total	9.184.168,40	100%			0,00%	0,74%	2,12%	6,07%	10,00%	12,97%	28,97%	49,13%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,60%	1,72%	3,56%	6,87%	9,77%	22,80%	41,30%

* 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.

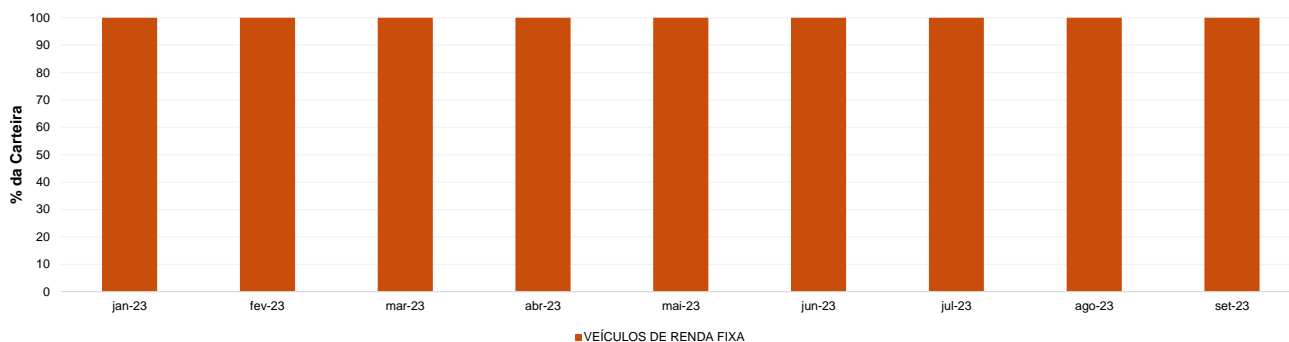
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

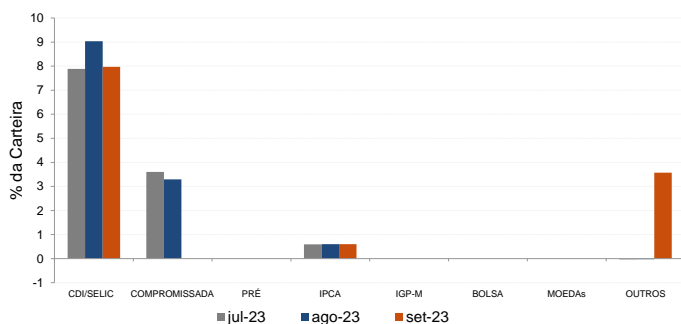
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais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

Evolução do Patrimônio Líquido

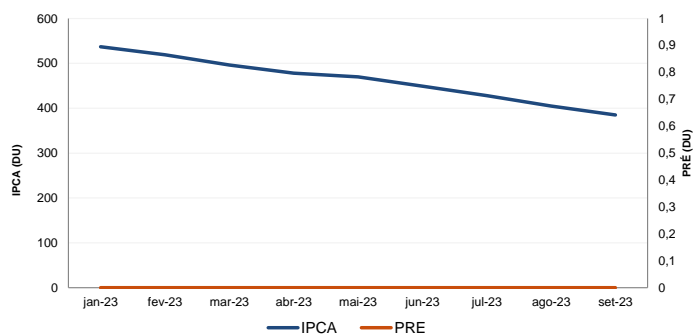


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/09/2023

Análises de Contrapartes

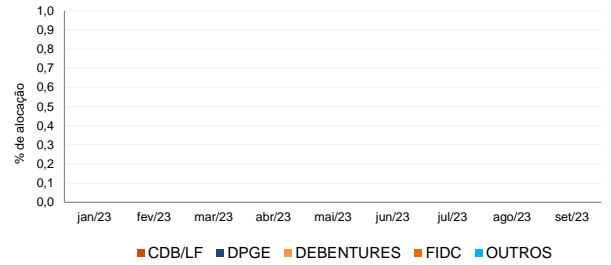
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/09/2023

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	29.055	0,32%	Selic	19-set-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	15.427	0,17%	Selic	27-set-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3.600	0,04%	Selic	19-set-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	7.559	0,08%	Selic	19-set-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	8.459	0,09%	Selic	27-set-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	10.284	0,11%	Selic	22-set-23	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II

