

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2021

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	661.238,46	100%			0,41%	1,08%	1,68%	1,98%	2,53%	5,77%	11,62%
Benchmark:	CDI				0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%
Renda Fixa CDI	661.238,46	100%		0,02%							
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	661.238,46	100%	BRADESCO	0,01%	0,42%	1,11%	1,72%	1,96%	2,37%	6,12%	12,59%
Benchmark:	CDI				0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%
Total	661.176,64	100%		0,02%	0,41%	1,08%	1,68%	1,98%	2,53%	5,77%	11,62%
Benchmark:	CDI				0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%

* 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.

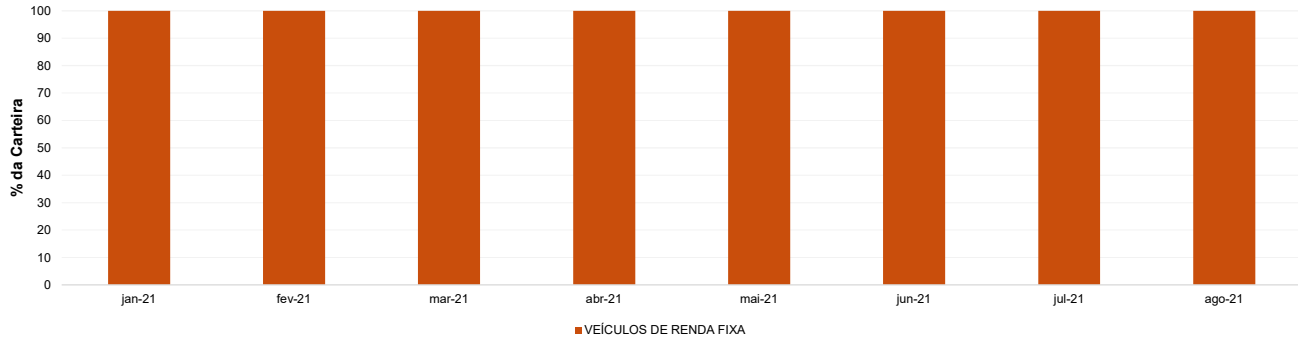
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

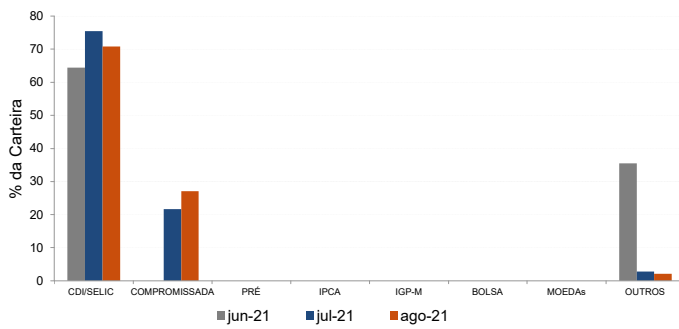
Distribuição da Carteira

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.

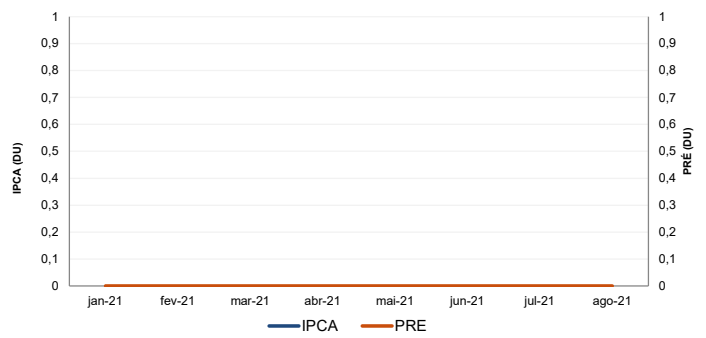
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2021

Análises de Contrapartes

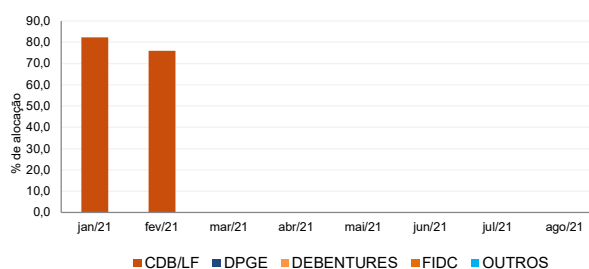
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Data-base: 31/08/2021

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 2021-09-01	01-set-21	6.948	1,05%	Selic	18-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	6.948	1,05%	Selic	18-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	6.863	1,04%	Selic	17-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.715	0,71%	Selic	17-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.744	0,57%	Selic	11-ago-21	0,09%	0,09%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.474	0,53%	Selic	18-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	103	0,02%	Selic	18-ago-21	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	8.645	1,31%	Selic	27-ago-21	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	15	0,00%	Selic	17-ago-21	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

