

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2021

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 | 654.169,59 | 100% | | | 0,27% | 0,59% | 1,18% | 0,88% | 1,86% | 6,08% | 11,99% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,27% | 0,67% | 1,13% | 0,96% | 2,18% | 7,17% | 14,00% |
| Renda Fixa CDI | 654.169,59 | 100% | | 0,06% | | | | | | | |
| BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA | 654.169,59 | 100% | BRADESCO | 0,00% | 0,28% | 0,60% | 1,05% | 0,84% | 1,78% | 6,53% | 13,13% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,27% | 0,67% | 1,13% | 0,96% | 2,18% | 7,17% | 14,00% |
| Total | 654.111,17 | 100% | | 0,06% | 0,27% | 0,59% | 1,18% | 0,88% | 1,86% | 6,08% | 11,99% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,27% | 0,67% | 1,13% | 0,96% | 2,18% | 7,17% | 14,00% |

* 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.

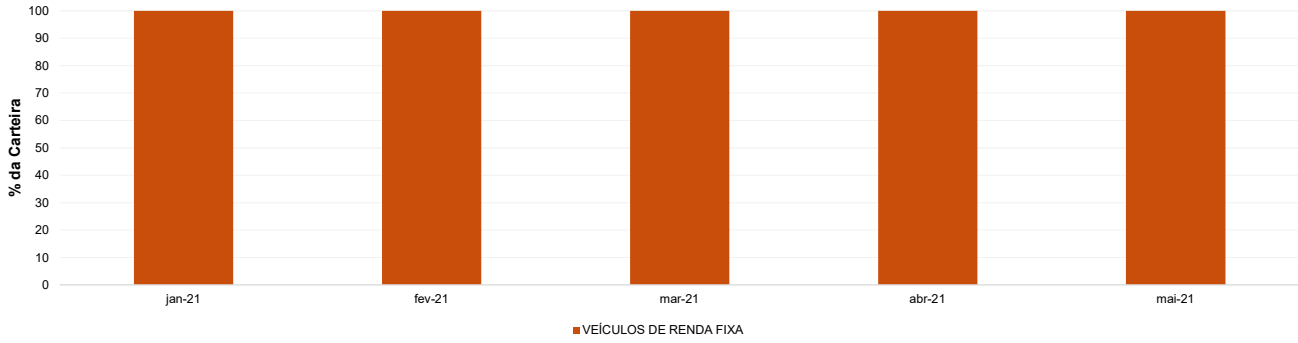
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2021

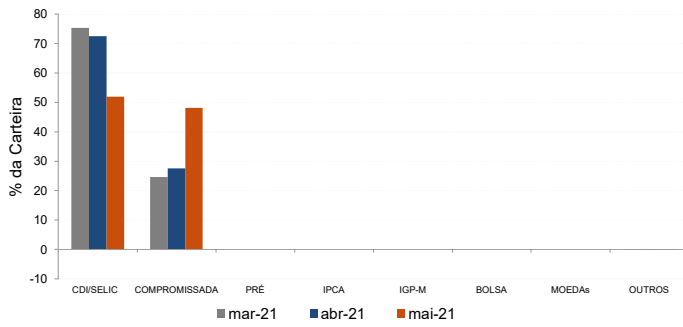
Distribuição da Carteira

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.

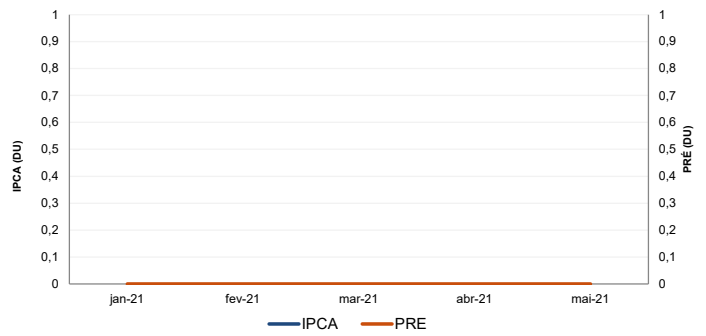
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2021

Análises de Contrapartes

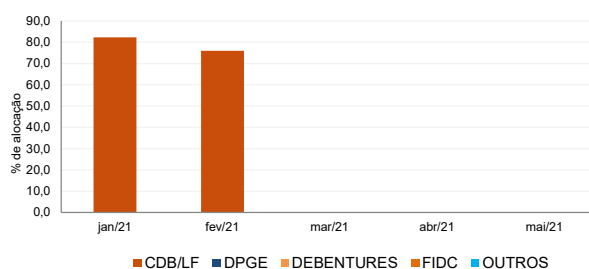
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2021

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 | 806 | 0,12% | Selic | 14-mai-21 | 0,09% | 0,09% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 3.131 | 0,48% | Selic | 04-mai-21 | 0,09% | 0,09% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 4.471 | 0,68% | Selic | 31-mai-21 | 0,11% | 0,11% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 2.233 | 0,34% | Selic | 31-mai-21 | 0,13% | 0,13% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 11.120 | 1,70% | Selic | 13-mai-21 | 0,25% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 4.448 | 0,68% | Selic | 13-mai-21 | 0,25% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 4.448 | 0,68% | Selic | 13-mai-21 | 0,25% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 200 | 0,03% | Selic | 19-mai-21 | 0,24% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 8.883 | 1,36% | Selic | 13-mai-21 | 0,26% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 4.441 | 0,68% | Selic | 31-mai-21 | 0,25% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 11.079 | 1,69% | Selic | 13-mai-21 | 0,31% | 0,31% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 4.432 | 0,68% | Selic | 31-mai-21 | 0,27% | 0,27% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 3.319 | 0,51% | Selic | 31-mai-21 | 0,28% | 0,28% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 2.212 | 0,34% | Selic | 31-mai-21 | 0,28% | 0,28% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 2.212 | 0,34% | Selic | 31-mai-21 | 0,28% | 0,28% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 5.519 | 0,84% | Selic | 13-mai-21 | 0,33% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 5.519 | 0,84% | Selic | 31-mai-21 | 0,29% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 2.198 | 0,34% | Selic | 13-mai-21 | 0,34% | 0,34% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |

