

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2021

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	651.585,32	100%			0,19%	0,48%	1,04%	0,48%	1,87%	6,65%	12,48%
Benchmark:	CDI				0,20%	0,48%	0,96%	0,48%	2,23%	7,80%	14,63%
Renda Fixa CDI	651.585,32	100%		0,07%							
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	651.585,32	100%	BRADESCO	0,01%	0,19%	0,42%	0,86%	0,42%	1,85%	7,19%	13,78%
Benchmark:	CDI				0,20%	0,48%	0,96%	0,48%	2,23%	7,80%	14,63%
Total	651.524,80	100%		0,07%	0,19%	0,48%	1,04%	0,48%	1,87%	6,65%	12,48%
Benchmark:	CDI				0,20%	0,48%	0,96%	0,48%	2,23%	7,80%	14,63%

* 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.

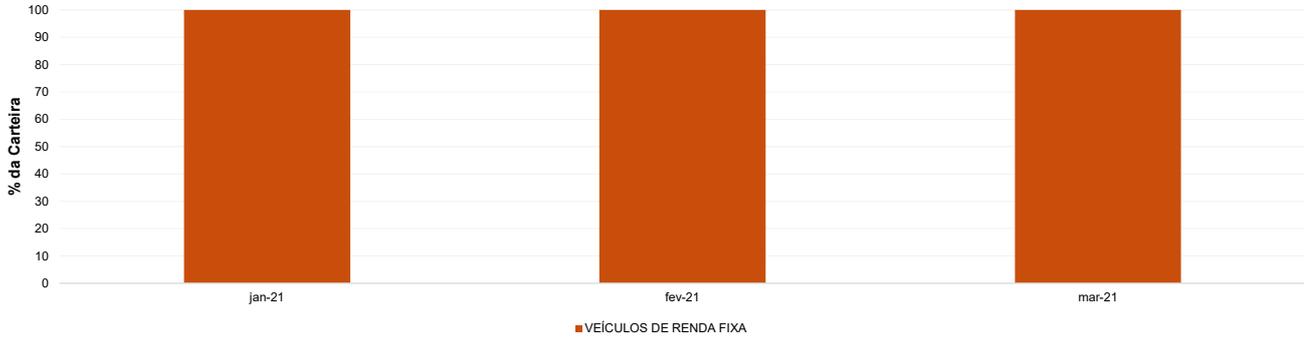
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2021

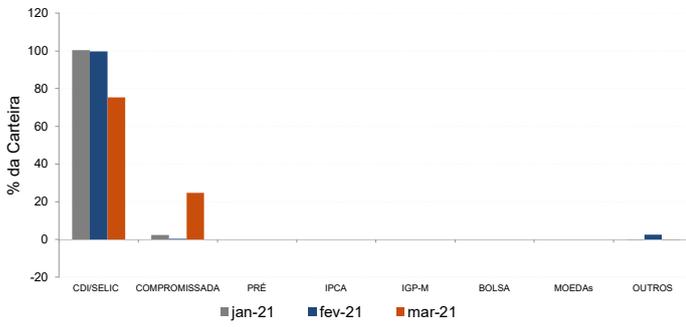
Distribuição da Carteira

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.

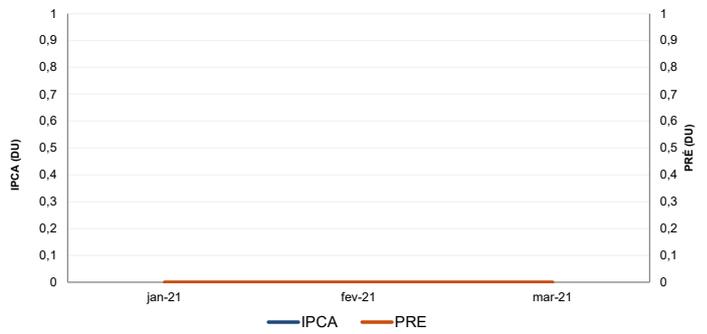
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2021

Análises de Contrapartes

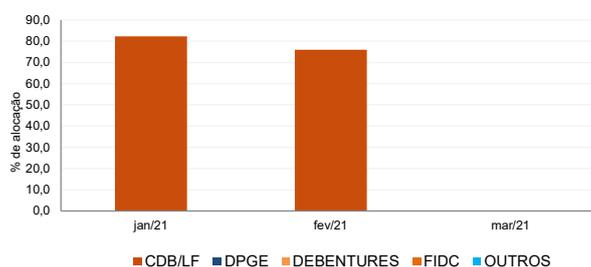
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2021

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	3.544	0,54%	Selic	01-mar-21	6,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.097	0,17%	Selic	16-mar-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	61	0,01%	Selic	16-mar-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	37.487	5,75%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	15.932	2,45%	Selic	05-mar-21	0,12%	0,12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.186	0,49%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.812	0,43%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	750	0,12%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	543	0,08%	Selic	26-mar-21	0,12%	0,12%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	8.270	1,27%	Selic	09-mar-21	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	28.044	4,30%	Selic	25-mar-21	0,14%	0,13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	32.655	5,01%	Selic	25-mar-21	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	23.695	3,64%	Selic	01-mar-21	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3.606	0,55%	Selic	18-mar-21	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.805	0,28%	Selic	18-mar-21	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.400	0,21%	Selic	26-mar-21	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	4.846	0,74%	Selic	09-mar-21	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	4.659	0,72%	Selic	26-mar-21	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.449	1,30%	Selic	09-mar-21	0,19%	0,19%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

