

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2021

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	671.182,87	100%			0,55%	1,50%	2,60%	3,50%	3,80%	6,13%	11,81%	
Benchmark:	CDI				0,59%	1,51%	2,62%	3,60%	3,77%	6,87%	13,38%	
Renda Fixa CDI	671.182,87	100%		0,03%								
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	671.182,87	100%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,57%	1,53%	2,66%	3,52%	3,73%	6,37%	12,65%
Benchmark:	CDI				0,59%	1,51%	2,62%	3,60%	3,77%	6,87%	13,38%	
Total	671.125,53	100%		0,03%	0,55%	1,50%	2,60%	3,50%	3,80%	6,13%	11,81%	
Benchmark:	CDI				0,59%	1,51%	2,62%	3,60%	3,77%	6,87%	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.

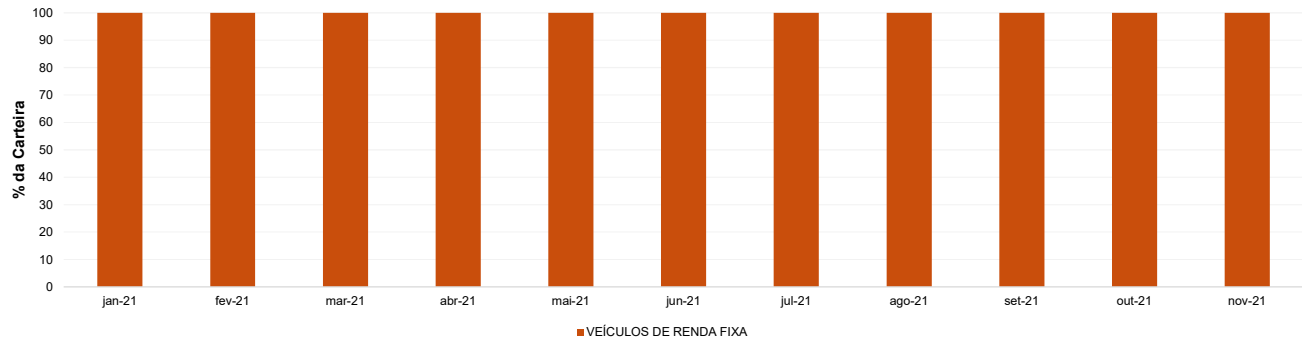
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2021

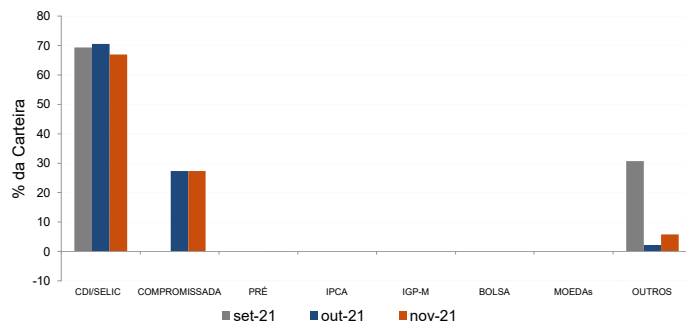
Distribuição da Carteira

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.

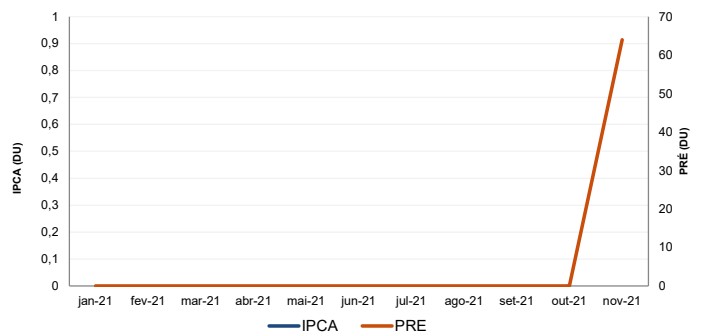
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2021

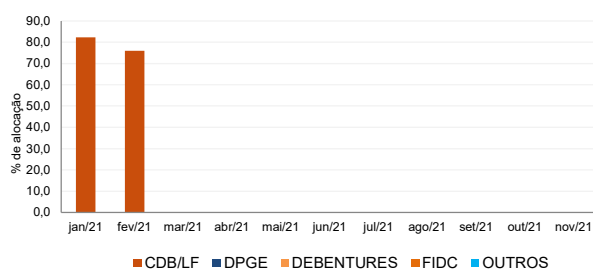
Análises de Contrapartes

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
------	------	---	---------------------------

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 PGA

Data-base: 30/11/2021

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 2022-03-01	01-mar-22	12.161	1,81%	Selic	19-nov-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	4.783	0,71%	Selic	03-nov-21	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	973	0,15%	Selic	22-nov-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	811	0,12%	Selic	22-nov-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	604	0,09%	Selic	05-nov-21	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	12.159	1,81%	Selic	19-nov-21	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	8.106	1,21%	Selic	22-nov-21	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	81	0,01%	Selic	22-nov-21	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.059	1,20%	Selic	09-nov-21	0,17%	0,17%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.020	0,60%	Selic	09-nov-21	0,22%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

