

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/09/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>664.130,40</b>	<b>100%</b>			<b>0,44%</b>	<b>1,22%</b>	<b>1,94%</b>	<b>2,43%</b>	<b>3,00%</b>	<b>5,81%</b>	<b>11,66%</b>
Benchmark:	CDI				0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>664.130,40</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>							
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	664.130,40		BRADESCO	0,01%	0,45%	1,25%	1,98%	2,41%	2,85%	6,11%	12,58%
Benchmark:	CDI				0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%
<b>Total</b>	<b>664.071,02</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>	<b>0,44%</b>	<b>1,22%</b>	<b>1,94%</b>	<b>2,43%</b>	<b>3,00%</b>	<b>5,81%</b>	<b>11,66%</b>
Benchmark:	CDI				0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%

\* 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.

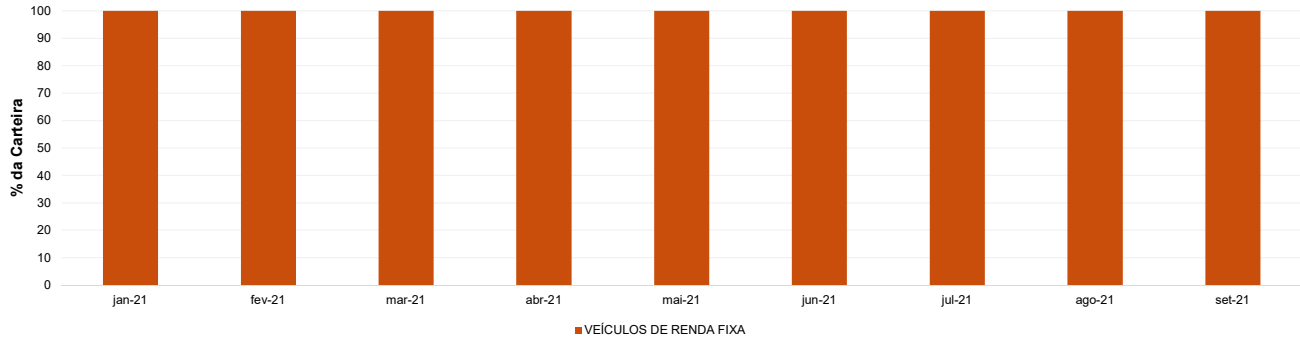
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

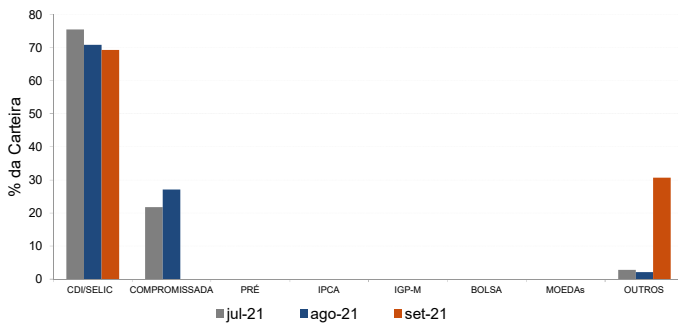
## Distribuição da Carteira

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.

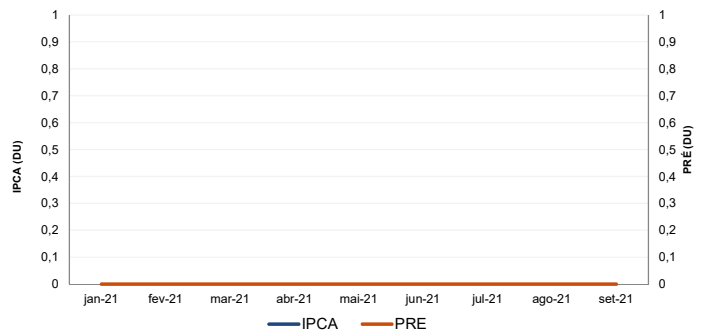
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/09/2021

## Análises de Contrapartes

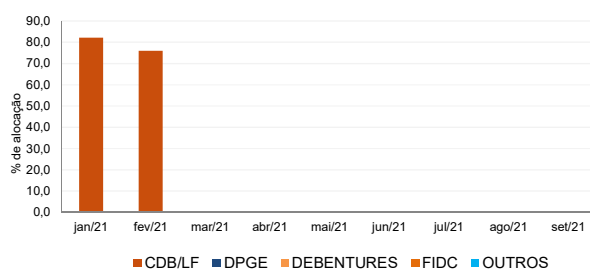
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 30/09/2021

## 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	4.959	0,75%	Selic	21-set-21	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.936	0,59%	Selic	09-set-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.149	0,47%	Selic	09-set-21	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	22.766	3,43%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	6.297	0,95%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.422	0,36%	Selic	02-set-21	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	134	0,02%	Selic	09-set-21	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	23.603	3,55%	Selic	09-set-21	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	8.635	1,30%	Selic	16-set-21	0,15%	0,16%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6.275	0,94%	Selic	01-set-21	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	10.972	1,65%	Selic	21-set-21	0,16%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.591	1,29%	Selic	28-set-21	0,21%	0,21%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

