

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2022

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	678.043,55	100%			0,73%	2,01%	3,40%	0,73%	4,87%	7,05%	12,40%
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
Renda Fixa CDI	678.043,55	100%		0,02%							
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	678.043,55	100%	BRADESCO	0,01%	0,74%	2,06%	3,46%	0,74%	4,89%	7,17%	13,18%
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
Total	677.986,49	100%		0,02%	0,73%	2,01%	3,40%	0,73%	4,87%	7,05%	12,40%
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%

* 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.

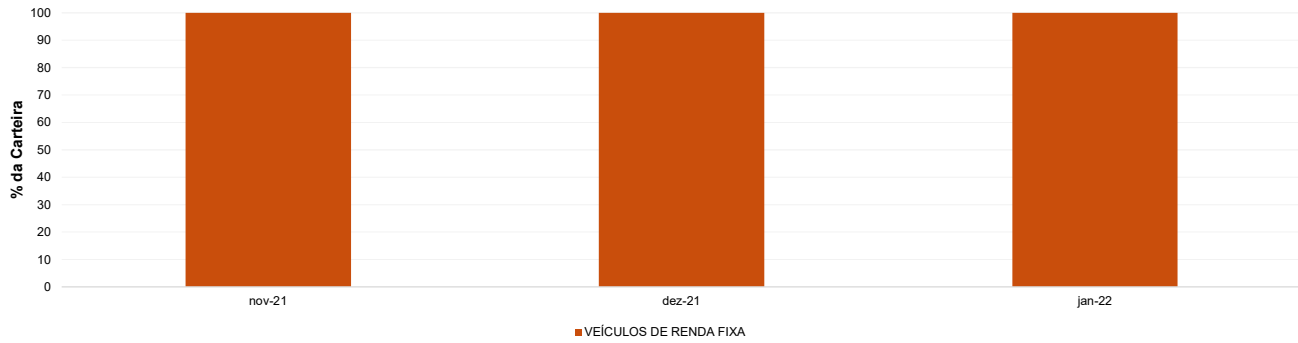
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2022

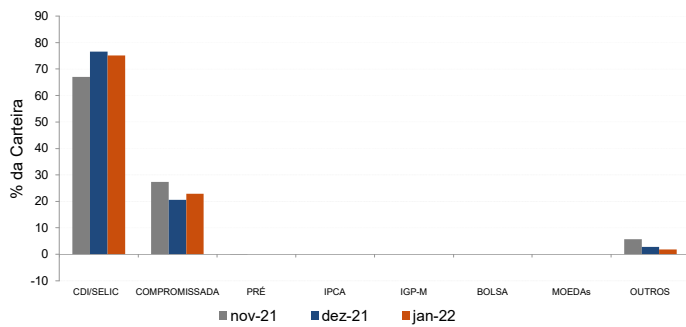
Distribuição da Carteira

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.

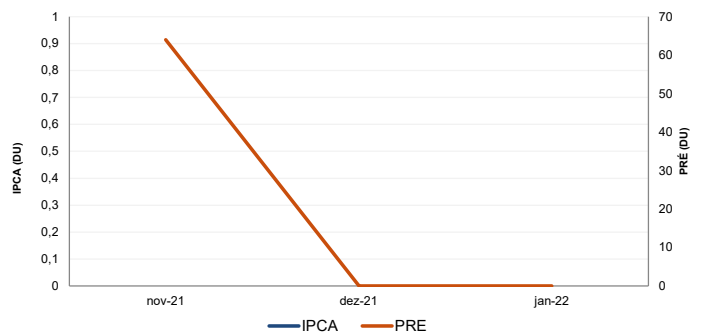
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2022

Análises de Contrapartes

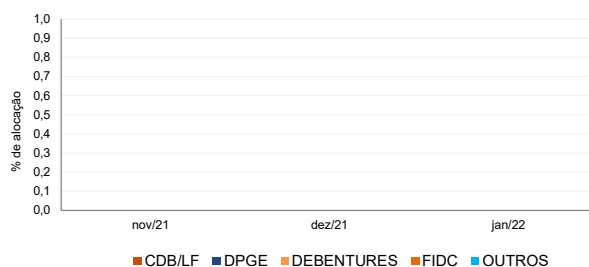
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/01/2022

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	6.408	0,95%	Selic	18-jan-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	879	0,13%	Selic	26-jan-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	520	0,08%	Selic	26-jan-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	866	0,13%	Selic	26-jan-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	8.658	1,28%	Selic	27-jan-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.502	0,66%	Selic	18-jan-22	4,00%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	433	0,06%	Selic	05-jan-22	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	35	0,01%	Selic	27-jan-22	5,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	11.242	1,66%	Selic	25-jan-22	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.189	0,77%	Selic	27-jan-22	7,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.730	0,26%	Selic	27-jan-22	7,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	865	0,13%	Selic	05-jan-22	0,11%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	26	0,00%	Selic	27-jan-22	7,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	12.965	1,91%	Selic	27-jan-22	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	8.643	1,27%	Selic	21-jan-22	0,09%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	4.322	0,64%	Selic	21-jan-22	0,09%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.889	0,57%	Selic	27-jan-22	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	2.589	0,38%	Selic	27-jan-22	0,11%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.170	0,76%	Selic	27-jan-22	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	431	0,06%	Selic	25-jan-22	0,15%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.299	0,63%	Selic	21-jan-22	0,19%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

