

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2022

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	597.421,63	100%			0,89%	2,39%	4,21%	2,39%	6,23%	8,21%	13,29%	
Benchmark:	CDI				0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%	
Renda Fixa CDI	597.421,63	100%		0,03%								
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	597.421,63	100%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,90%	2,42%	4,28%	2,42%	6,35%	8,32%	14,00%
Benchmark:	CDI				0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%	
Total	597.364,01	100%		0,03%	0,89%	2,39%	4,21%	2,39%	6,23%	8,21%	13,29%	
Benchmark:	CDI				0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%	

* 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.

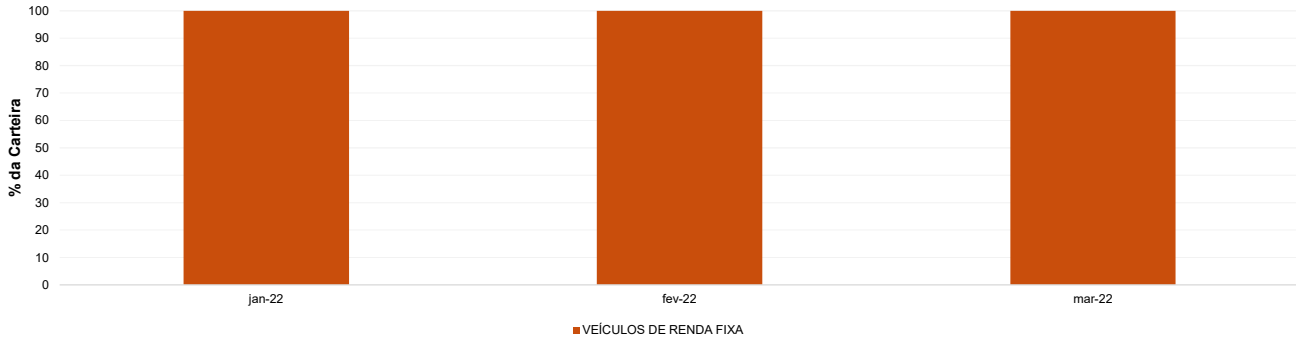
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2022

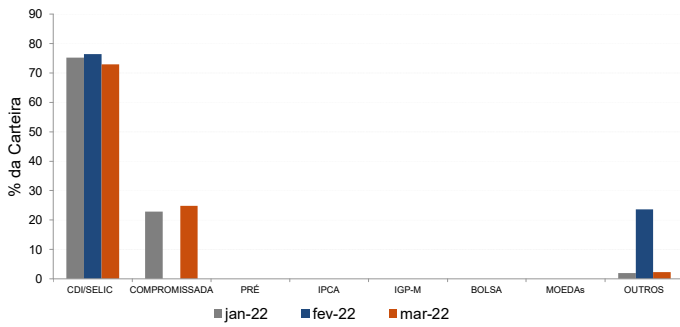
Distribuição da Carteira

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.

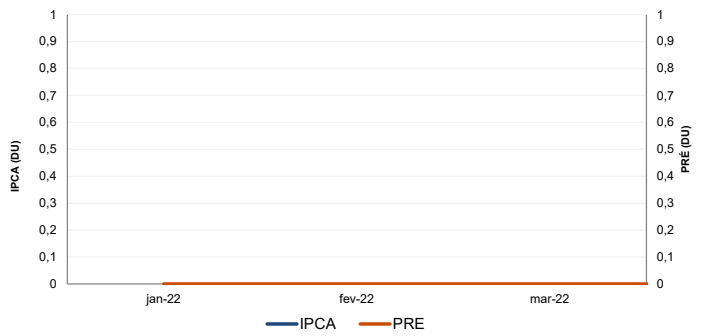
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/03/2022

Análises de Contrapartes

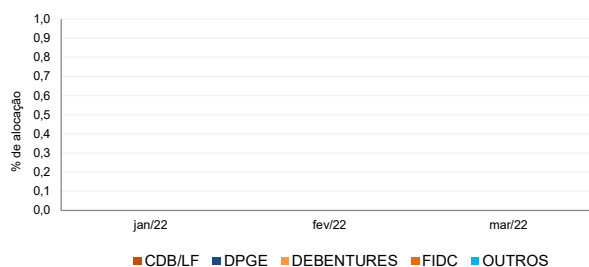
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/03/2022

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 2022-09-01	01-set-22	16.218	2,71%	Selic	08-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.622	0,27%	Selic	31-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	105	0,02%	Selic	31-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	8	0,00%	Selic	31-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	811	0,14%	Selic	31-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	405	0,07%	Selic	31-mar-22	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	8.105	1,36%	Selic	14-mar-22	0,03%	0,03%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	28	0,00%	Selic	02-mar-22	0,03%	0,03%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.216	0,20%	Selic	29-mar-22	0,03%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	405	0,07%	Selic	30-mar-22	0,03%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.088	1,35%	Selic	10-mar-22	0,08%	0,08%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.044	0,68%	Selic	11-mar-22	0,08%	0,08%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2.815	0,47%	Selic	11-mar-22	0,17%	0,17%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

