

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/04/2022

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 | 601.524,21 | 100% | | | 0,69% | 2,35% | 4,41% | 3,10% | 6,82% | 8,77% | 13,56% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,83% | 2,53% | 4,68% | 3,28% | 7,08% | 9,38% | 15,07% |
| Renda Fixa CDI | 601.524,21 | 100% | | 0,09% | | | | | | | |
| BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA | 601.524,21 | 100% | BRADESCO | 0,01% | 0,70% | 2,38% | 4,48% | 3,14% | 6,95% | 8,79% | 14,22% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,83% | 2,53% | 4,68% | 3,28% | 7,08% | 9,38% | 15,07% |
| Total | 601.474,69 | 100% | | 0,09% | 0,69% | 2,35% | 4,41% | 3,10% | 6,82% | 8,77% | 13,56% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,83% | 2,53% | 4,68% | 3,28% | 7,08% | 9,38% | 15,07% |

* 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.

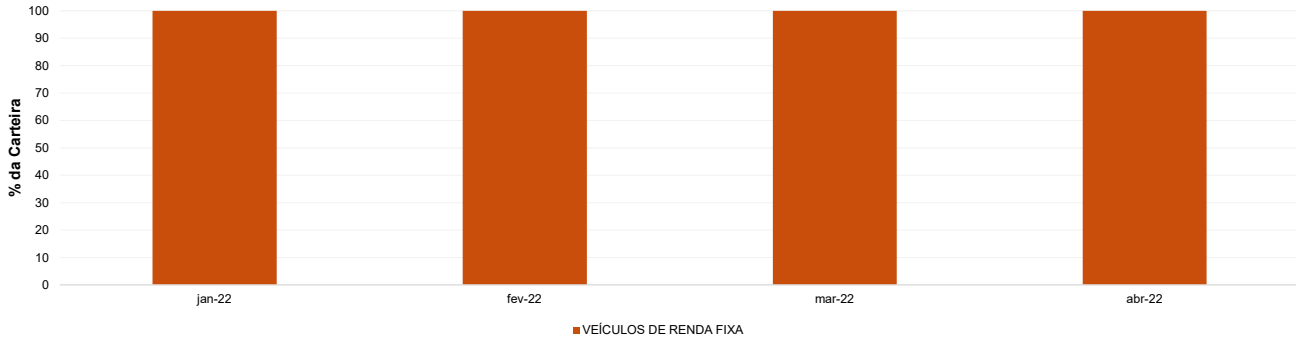
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/04/2022

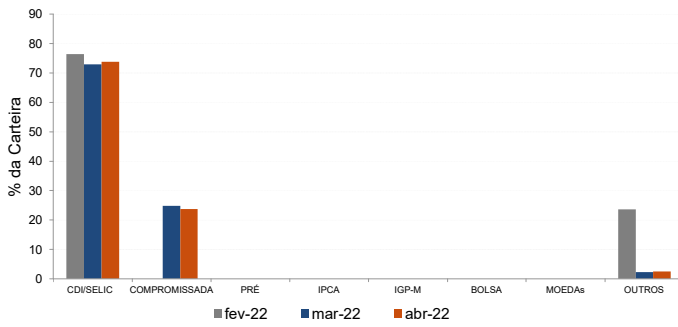
Distribuição da Carteira

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.

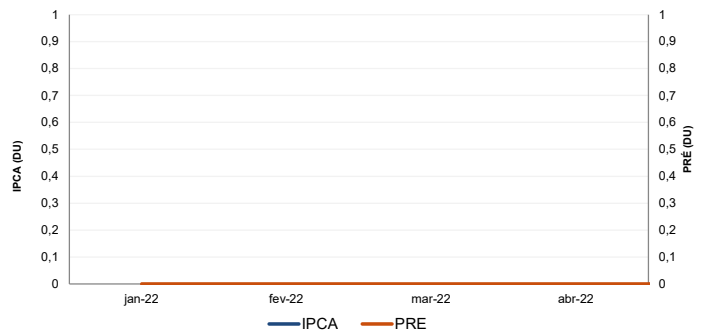
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/04/2022

Análises de Contrapartes

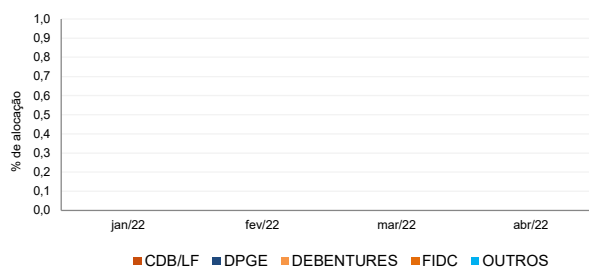
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/04/2022

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 | 4.564 | 0,76% | Selic | 19-abr-22 | 0,02% | 0,03% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 2.194 | 0,36% | Selic | 04-abr-22 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 878 | 0,15% | Selic | 08-abr-22 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 878 | 0,15% | Selic | 08-abr-22 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 878 | 0,15% | Selic | 04-abr-22 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 44 | 0,01% | Selic | 08-abr-22 | 0,01% | 0,01% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 1.749 | 0,29% | Selic | 22-abr-22 | 0,13% | 0,13% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 6.113 | 1,02% | Selic | 25-abr-22 | 0,14% | 0,14% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 8.723 | 1,45% | Selic | 19-abr-22 | 0,14% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 4.361 | 0,73% | Selic | 22-abr-22 | 0,16% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 870 | 0,14% | Selic | 22-abr-22 | 0,21% | 0,21% | BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |

