

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2022

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	607.622,43	100%			0,97%	2,57%	4,84%	4,09%	7,57%	9,56%	14,11%	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
Renda Fixa CDI	607.622,43	100%		0,08%								
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	607.622,43	100%	BRADESCO	0,01%	0,08%	1,02%	2,65%	4,96%	4,19%	7,74%	9,66%	14,78%
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
Total	607.569,12	100%		0,08%	0,97%	2,57%	4,84%	4,09%	7,57%	9,56%	14,11%	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	

* 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.

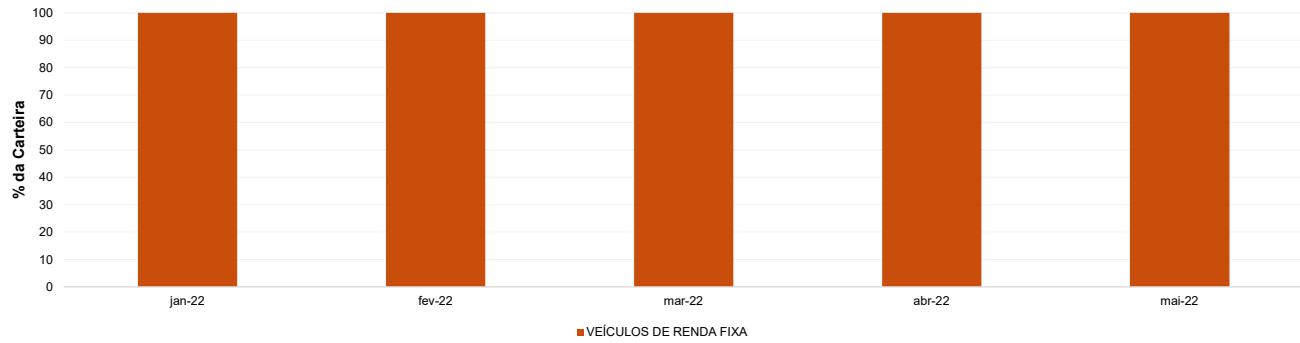
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2022

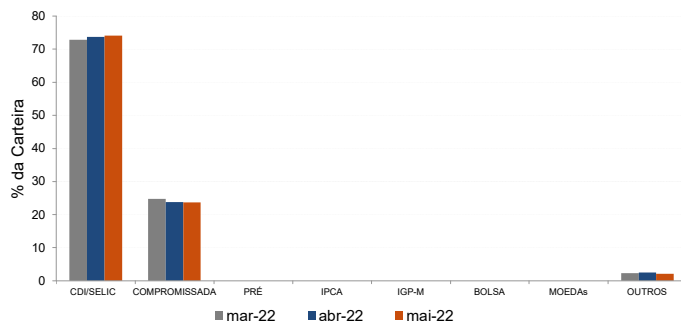
Distribuição da Carteira

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.

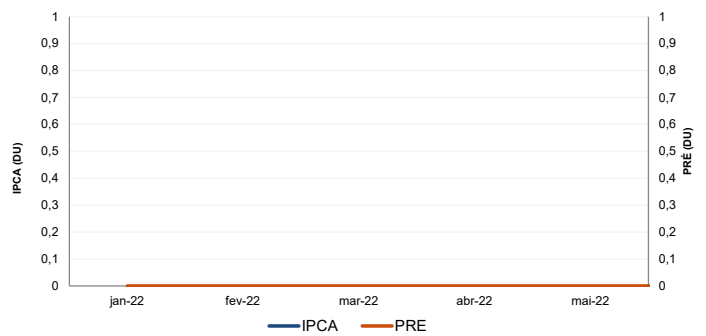
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2022

Análises de Contrapartes

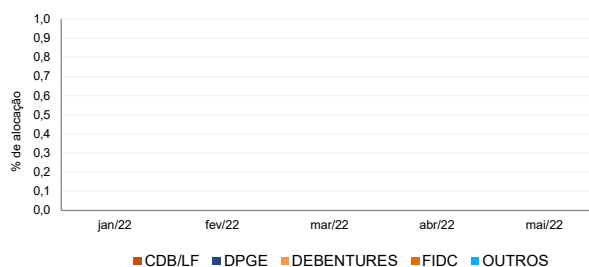
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2022

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 2023-03-01	01-mar-23	3.108	0,51%	Selic	27-mai-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.033	0,33%	Selic	27-mai-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	613	0,10%	Selic	31-mai-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	311	0,05%	Selic	30-mai-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.217	0,36%	Selic	19-mai-22	0,09%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	7	0,00%	Selic	30-mai-22	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.649	0,44%	Selic	13-mai-22	0,15%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	3.303	0,54%	Selic	19-mai-22	0,17%	0,17%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

