

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/06/2022

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	613.626,16	100%			0,99%	2,67%	5,12%	5,12%	8,31%	10,58%	14,75%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
Renda Fixa CDI	613.626,16	100%		0,06%								
BRADESCO FIRF REF DI FEDERAL EXTRA	613.626,16	100%	BRADESCO	0,01%	0,06%	1,00%	2,75%	5,23%	5,23%	8,48%	10,53%	15,40%
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
Total	613.571,48	100%		0,06%	0,99%	2,67%	5,12%	5,12%	8,31%	10,58%	14,75%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	

* 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.

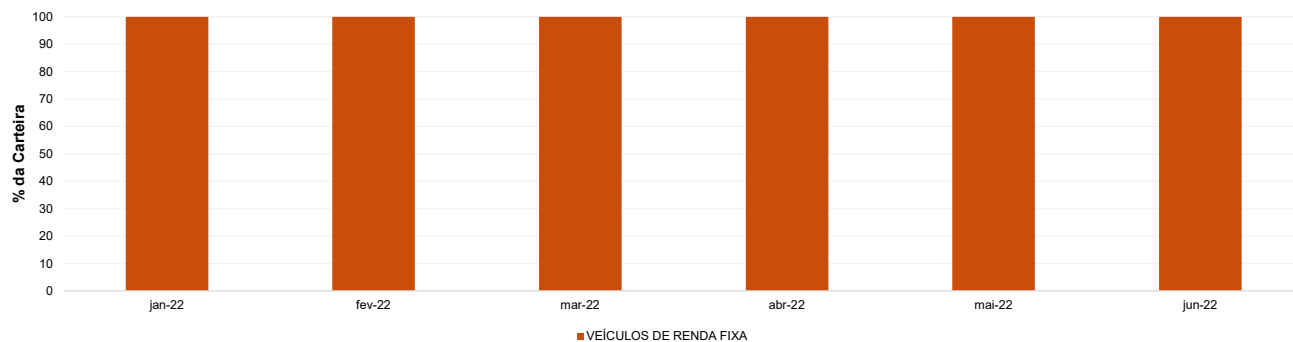
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

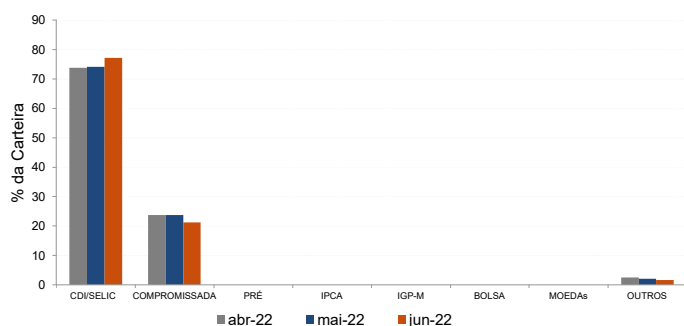
Distribuição da Carteira

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.

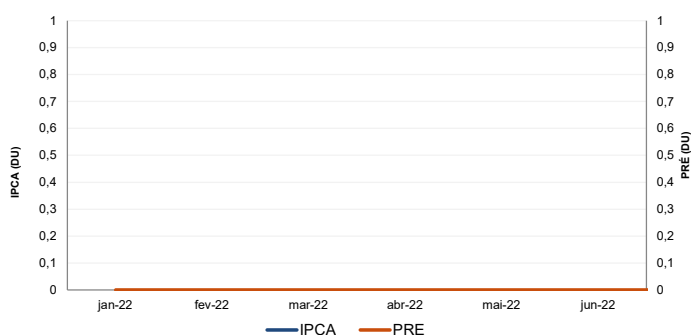
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/06/2022

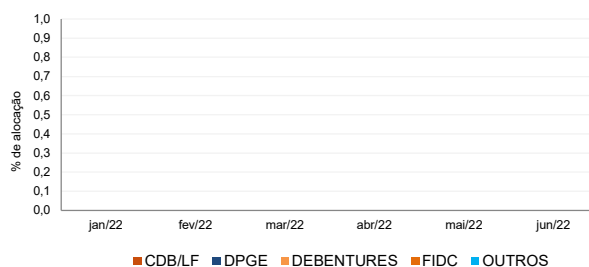
Análises de Contrapartes

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

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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: 30/06/2022

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	3.939	0,64%	Selic	29-jun-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.326	0,38%	Selic	07-jun-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.093	0,34%	Selic	09-jun-22	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	13.951	2,27%	Selic	20-jun-22	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	3	0,00%	Selic	01-jun-22	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1	0,00%	Selic	22-jun-22	5,00%	0,05%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	2.784	0,45%	Selic	15-jun-22	0,11%	0,11%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.562	0,91%	Selic	15-jun-22	0,13%	0,13%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	4.619	0,75%	Selic	15-jun-22	0,17%	0,16%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

