

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2022

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>626.901,52</b>	<b>100%</b>			<b>1,15%</b>	<b>3,17%</b>	<b>5,82%</b>	<b>7,40%</b>	<b>9,79%</b>	<b>12,56%</b>	<b>16,13%</b>	
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>626.901,52</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>								
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	626.901,52	100%	BRADESCO	0,01%	0,02%	1,16%	3,20%	5,93%	7,53%	9,97%	12,58%	16,70%
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>Total</b>	<b>626.840,83</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>	<b>1,15%</b>	<b>3,17%</b>	<b>5,82%</b>	<b>7,40%</b>	<b>9,79%</b>	<b>12,56%</b>	<b>16,13%</b>	
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%	

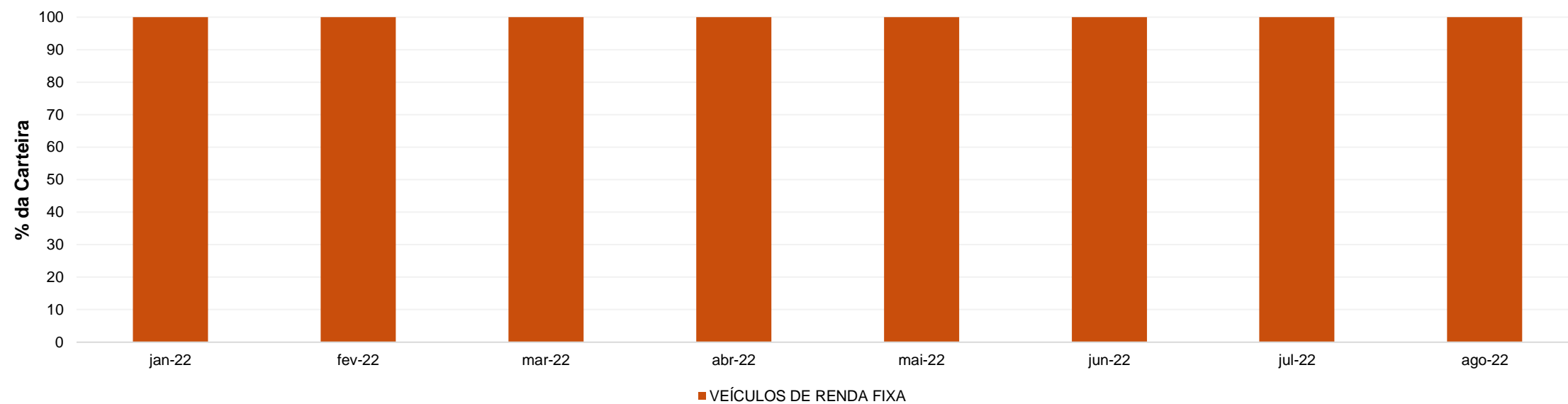
\* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC. O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML 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.

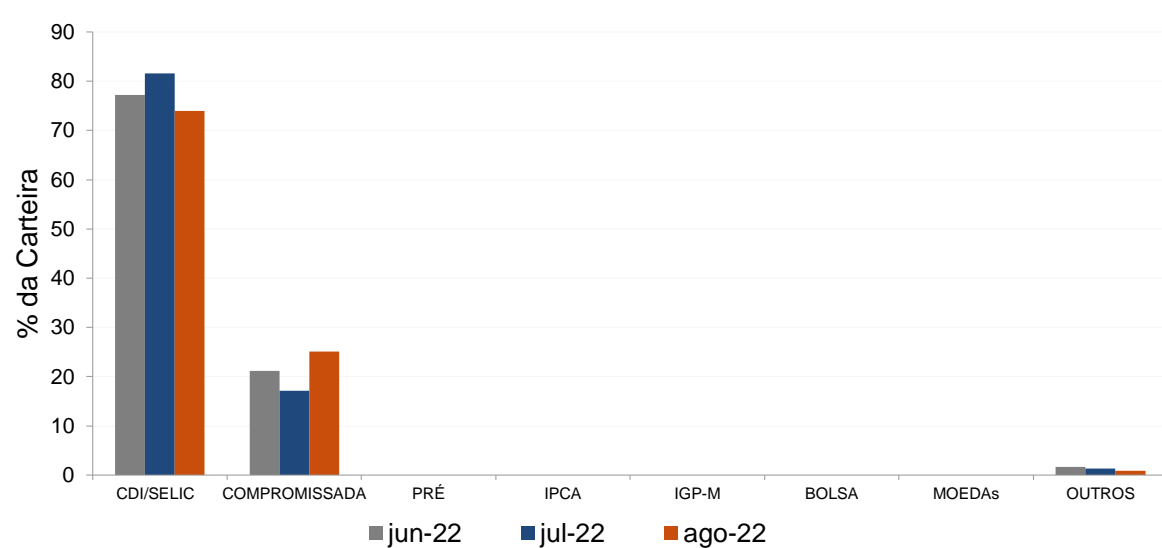
## Distribuição da Carteira

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.

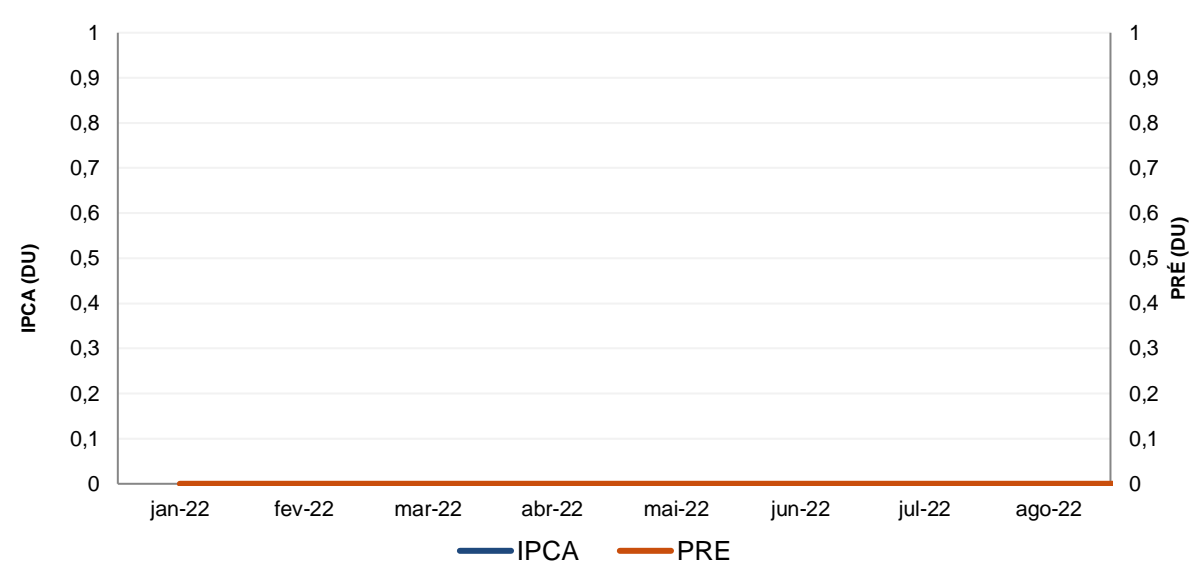
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2022

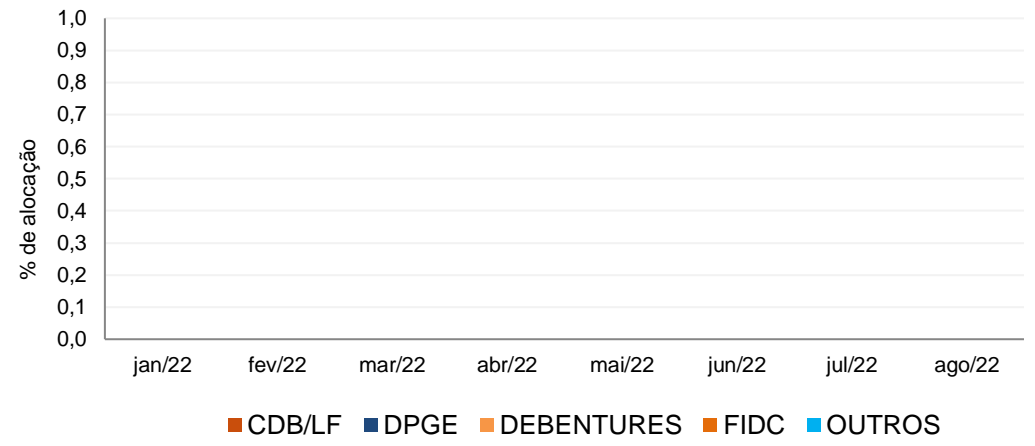
## Análises de Contrapartes

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: 31/08/2022

## 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	3.019	0,48%	Selic	26-ago-22	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.006	0,16%	Selic	29-ago-22	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	151	0,02%	Selic	30-ago-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.007	0,80%	Selic	05-ago-22	5,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	3.365	0,54%	Selic	31-ago-22	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	653	0,10%	Selic	31-ago-22	0,08%	0,08%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.016	0,80%	Selic	31-ago-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	853	0,14%	Selic	26-ago-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	351	0,06%	Selic	31-ago-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	150	0,02%	Selic	31-ago-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

