

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2023

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>713,866.80</b> | <b>100%</b> |            |                  | <b>1.12%</b>   | <b>3.25%</b> | <b>6.47%</b> | <b>8.62%</b> | <b>13.10%</b> | <b>24.17%</b> | <b>27.31%</b> |
| Benchmark:                          | CDI               |             |            |                  | 1.14%          | 3.32%        | 6.68%        | 8.87%        | 13.55%        | 25.14%        | 28.52%        |
| <b>Renda Fixa CDI</b>               | <b>713,866.80</b> | <b>100%</b> |            | <b>0.02%</b>     |                |              |              |              |               |               |               |
| BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA | 713,866.80        | 100%        | BRADESCO   | 0.01%            | 1.13%          | 3.27%        | 6.54%        | 8.69%        | 13.28%        | 24.58%        | 27.53%        |
| Benchmark:                          | CDI               |             |            |                  | 1.14%          | 3.32%        | 6.68%        | 8.87%        | 13.55%        | 25.14%        | 28.52%        |
| <b>Total</b>                        | <b>713,797.60</b> | <b>100%</b> |            | <b>0.02%</b>     | <b>1.12%</b>   | <b>3.25%</b> | <b>6.47%</b> | <b>8.62%</b> | <b>13.10%</b> | <b>24.17%</b> | <b>27.31%</b> |
| Benchmark:                          | CDI               |             |            |                  | 1.14%          | 3.32%        | 6.68%        | 8.87%        | 13.55%        | 25.14%        | 28.52%        |

\* 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.

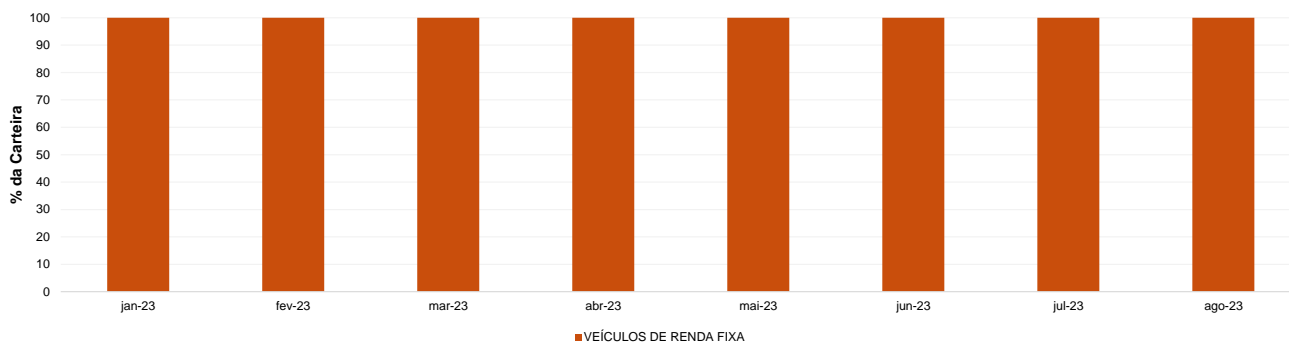
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este 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.

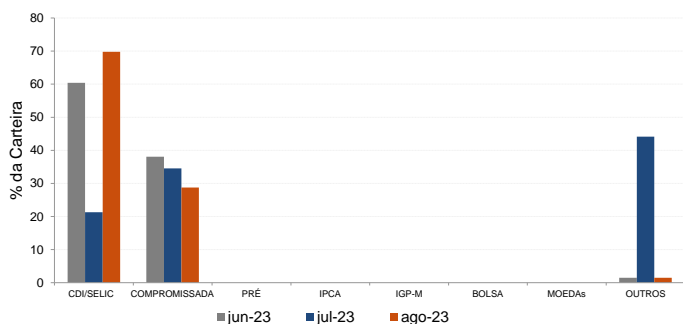
## Distribuição da Carteira

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.

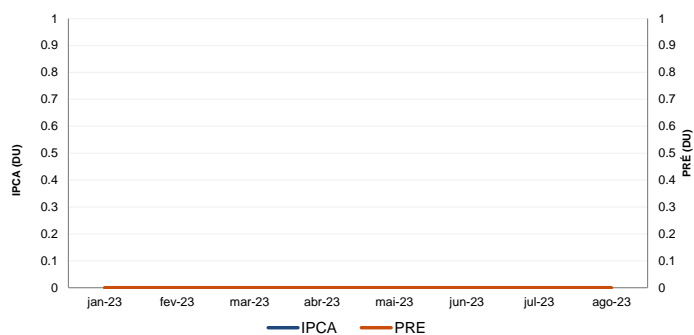
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2023

## Análises de Contrapartes

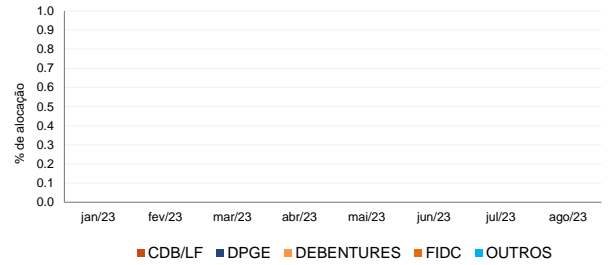
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/08/2023

## 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 2023-09-01   | 01-set-23  | 4,660  | 0.65%           | Selic     | 09-ago-23   | 5.00%        | 0.05%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 3,742  | 0.52%           | Selic     | 09-ago-23   | 5.00%        | 0.05%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 963    | 0.13%           | Selic     | 09-ago-23   | 5.00%        | 0.05%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 932    | 0.13%           | Selic     | 09-ago-23   | 5.00%        | 0.05%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-09-01   | 01-set-23  | 93     | 0.01%           | Selic     | 09-ago-23   | 5.00%        | 0.05%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01   | 01-mar-24  | 9,320  | 1.31%           | Selic     | 01-ago-23   | 0.01%        | 0.00%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01   | 01-mar-24  | 252    | 0.04%           | Selic     | 07-ago-23   | 0.00%        | 0.00%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-09-01   | 01-set-24  | 13,980 | 1.96%           | Selic     | 29-ago-23   | 0.00%        | 0.00%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01   | 01-mar-25  | 9,319  | 1.31%           | Selic     | 29-ago-23   | 0.01%        | 0.01%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 373    | 0.05%           | Selic     | 07-ago-23   | 0.02%        | 0.03%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01   | 01-set-25  | 186    | 0.03%           | Selic     | 07-ago-23   | 0.02%        | 0.03%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2027-03-01   | 01-mar-27  | 1,857  | 0.26%           | Selic     | 03-ago-23   | 0.12%        | 0.12%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2027-09-01   | 01-set-27  | 6,491  | 0.91%           | Selic     | 03-ago-23   | 0.14%        | 0.00%          | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |

