

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/12/2023

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>740.179,28</b>	<b>100%</b>			<b>0,87%</b>	<b>2,72%</b>	<b>5,93%</b>	<b>12,63%</b>	<b>12,63%</b>	<b>25,95%</b>	<b>31,30%</b>
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>740.179,28</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>							
BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA	740.179,28	100%	BRADESCO	0,01%	0,88%	2,74%	5,98%	12,74%	12,74%	26,34%	31,75%
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
<b>Total</b>	<b>740.118,49</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,87%</b>	<b>2,72%</b>	<b>5,93%</b>	<b>12,63%</b>	<b>12,63%</b>	<b>25,95%</b>	<b>31,30%</b>
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%

\* 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.

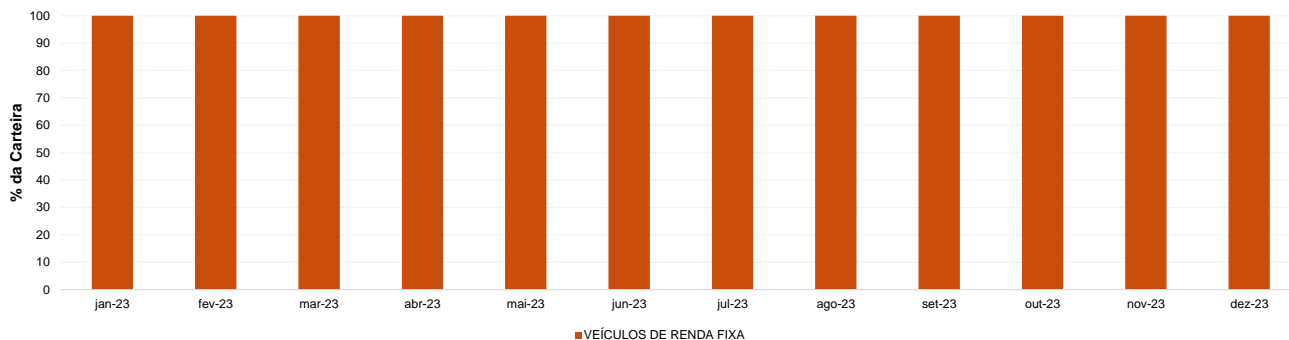
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

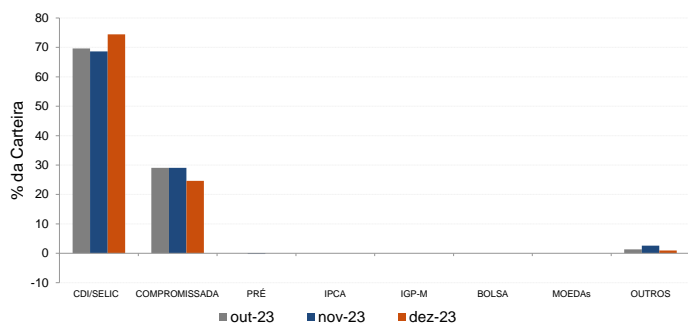
## Distribuição da Carteira

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.

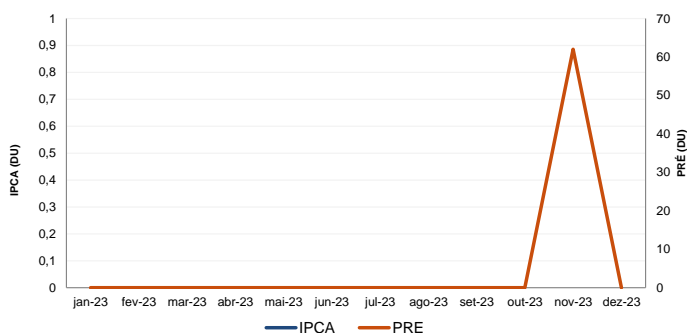
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/12/2023

## Análises de Contrapartes

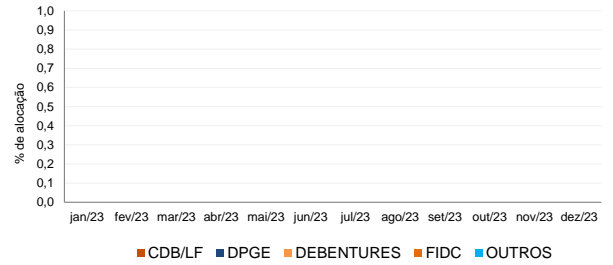
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/12/2023

## 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 2024-03-01	01-mar-24	3.349	0,45%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.477	0,20%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	14.773	2,00%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.447	0,47%	Selic	13-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.536	0,34%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.477	0,20%	Selic	14-dez-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	788	0,11%	Selic	19-dez-23	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2028-03-01	01-mar-28	9.801	1,32%	Selic	14-dez-23	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT