

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2023

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>691.453,10</b>	<b>100%</b>			<b>1,09%</b>	<b>3,13%</b>	<b>6,30%</b>	<b>5,21%</b>	<b>13,02%</b>	<b>21,57%</b>	<b>23,83%</b>	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>691.453,10</b>	<b>100%</b>		<b>0,03%</b>								
BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA	691.453,10		BRADESCO	0,01%	0,03%	1,11%	3,17%	6,41%	5,25%	13,20%	21,97%	24,14%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	
<b>Total</b>	<b>691.387,20</b>	<b>100%</b>		<b>0,03%</b>	<b>1,09%</b>	<b>3,13%</b>	<b>6,30%</b>	<b>5,21%</b>	<b>13,02%</b>	<b>21,57%</b>	<b>23,83%</b>	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	

\* 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.

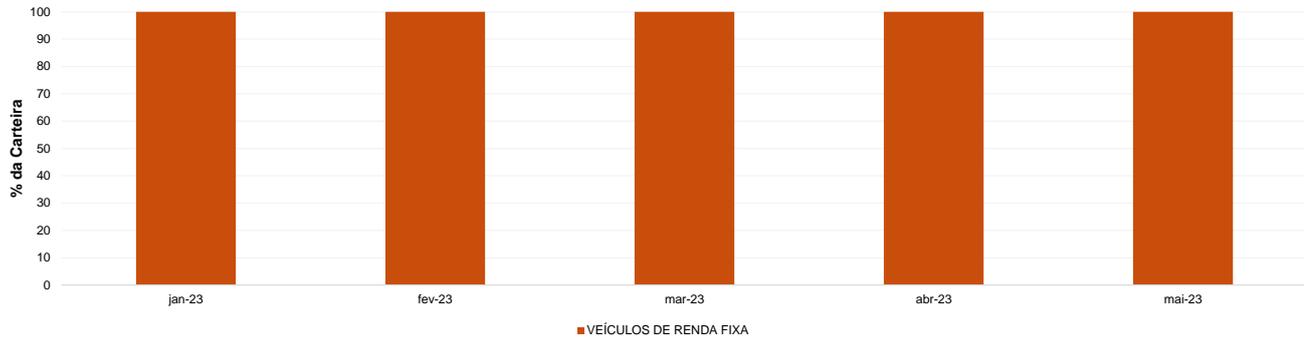
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2023

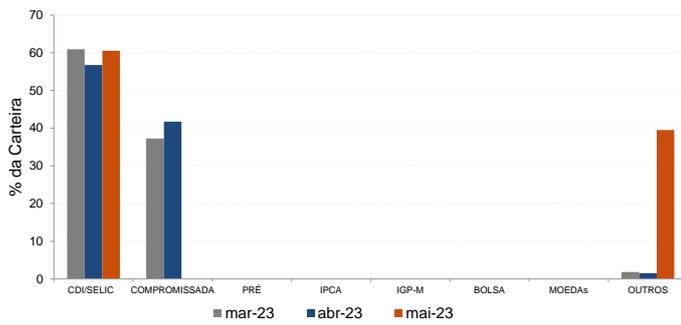
## Distribuição da Carteira

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.

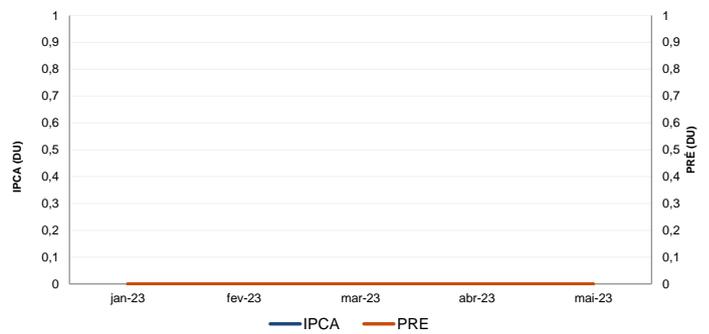
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/05/2023

## Análises de Contrapartes

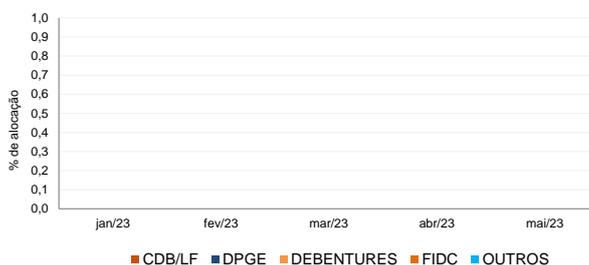
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 31/05/2023

## 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 2024-09-01	01-set-24	4.843	0,70%	Selic	19-mai-23	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1.282	0,19%	Selic	09-mai-23	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.821	0,41%	Selic	09-mai-23	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	12.193	1,76%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.877	0,71%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	8.509	1,23%	Selic	29-mai-23	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	9.560	1,38%	Selic	12-mai-23	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	3.187	0,46%	Selic	12-mai-23	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	1.699	0,25%	Selic	09-mai-23	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT

