

## RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2023

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>733,746.40</b>	<b>100%</b>			<b>0.87%</b>	<b>2.80%</b>	<b>6.14%</b>	<b>11.66%</b>	<b>12.82%</b>	<b>25.76%</b>	<b>30.55%</b>
Benchmark:	CDI				0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>733,746.40</b>	<b>100%</b>		<b>0.02%</b>							
BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA	733,746.40	100%	BRADESCO	0.01%	0.88%	2.82%	6.19%	11.76%	12.99%	26.16%	30.87%
Benchmark:	CDI				0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%
<b>Total</b>	<b>733,744.16</b>	<b>100%</b>		<b>0.02%</b>	<b>0.87%</b>	<b>2.80%</b>	<b>6.14%</b>	<b>11.66%</b>	<b>12.82%</b>	<b>25.76%</b>	<b>30.55%</b>
Benchmark:	CDI				0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%

\* 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.

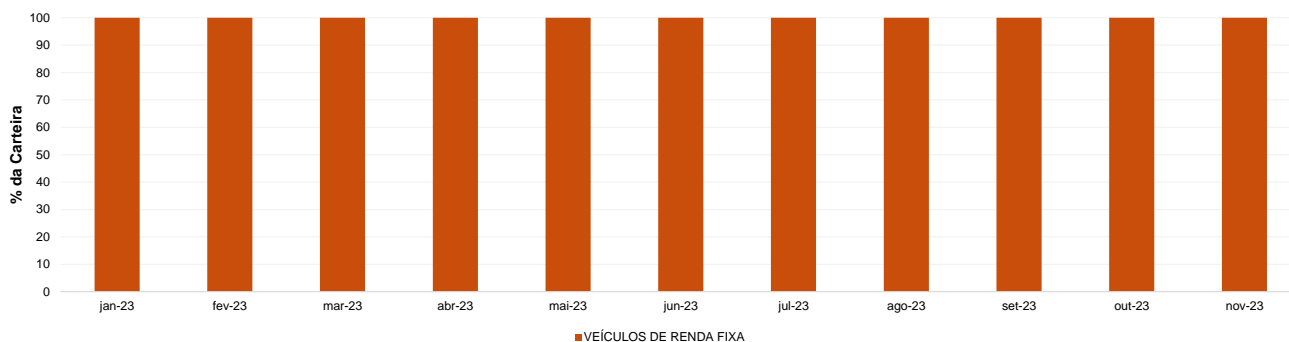
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

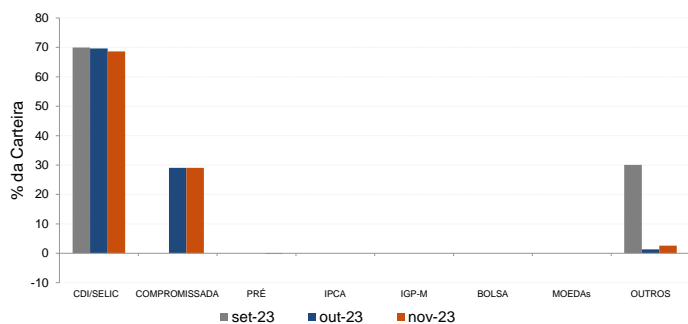
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

### Evolução do Patrimônio Líquido

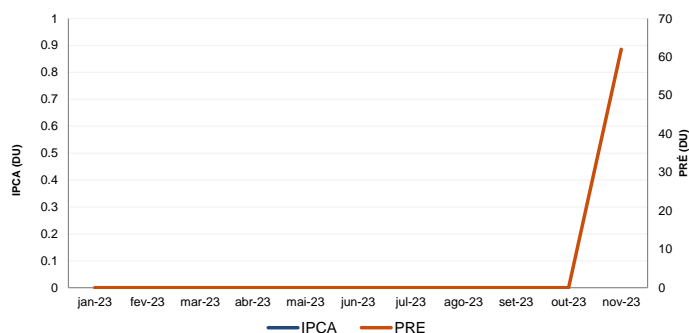


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/11/2023

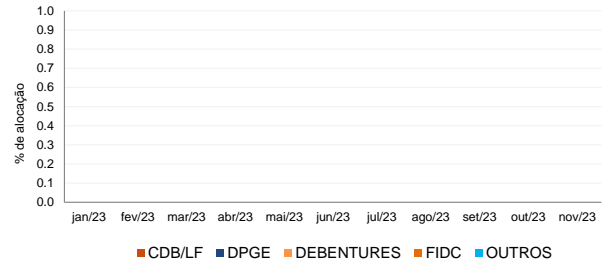
## Análises de Contrapartes

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
------	------	---	---------------------------

### 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: 30/11/2023

## 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	905	0.12%	Selic	03-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	905	0.12%	Selic	03-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	643	0.09%	Selic	03-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	4,527	0.62%	Selic	03-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	12,221	1.67%	Selic	23-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	4,526	0.62%	Selic	03-nov-23	0.00%	0.00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	389	0.05%	Selic	29-nov-23	0.01%	0.01%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	5,883	0.80%	Selic	23-nov-23	0.01%	0.02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT

