

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/10/2023

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
Renda Fixa	727.459,95	100%			0,95%	3,05%	6,36%	10,70%	12,94%	25,36%	29,66%
Benchmark:	CDI				1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%
Renda Fixa CDI	727.459,95	100%		0,01%							
BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA	727.459,95		BRADESCO	0,01%	0,96%	3,08%	6,43%	10,78%	13,12%	25,77%	29,88%
Benchmark:	CDI				1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%
Total	727.395,08	100%		0,01%	0,95%	3,05%	6,36%	10,70%	12,94%	25,36%	29,66%
Benchmark:	CDI				1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%

* 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.

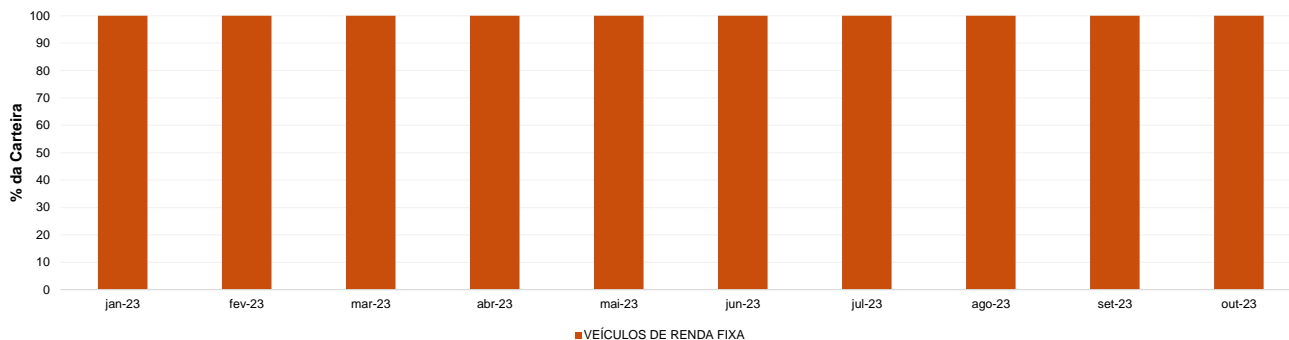
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

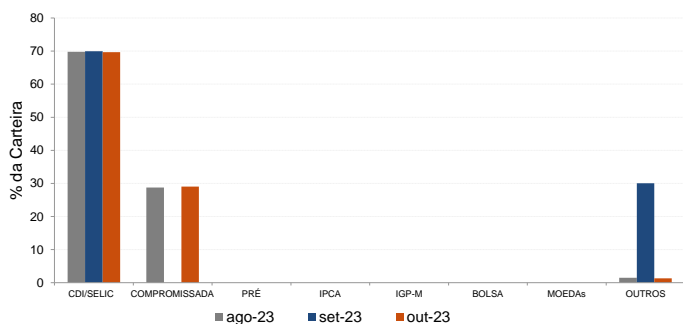
Distribuição da Carteira

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.

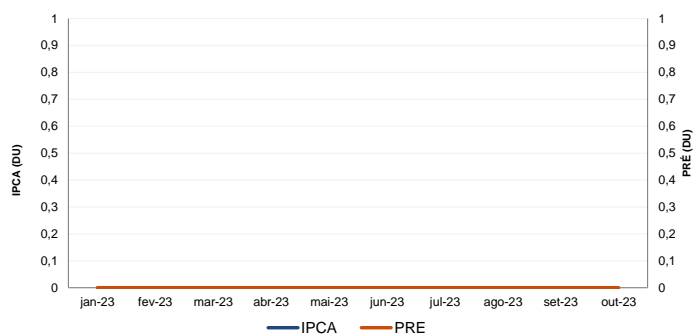
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/10/2023

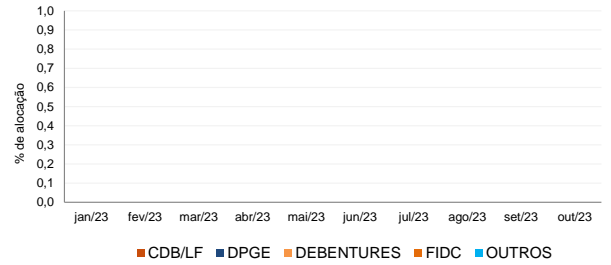
Análises de Contrapartes

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: 31/10/2023

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	12.629	1,74%	Selic	03-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	8.790	1,21%	Selic	02-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6.135	0,84%	Selic	23-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	4.835	0,66%	Selic	23-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.934	0,27%	Selic	23-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.758	0,24%	Selic	19-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	879	0,12%	Selic	23-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	246	0,03%	Selic	02-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.318	0,18%	Selic	17-out-23	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.405	0,19%	Selic	02-out-23	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	2.632	0,36%	Selic	03-out-23	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	2.193	0,30%	Selic	17-out-23	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	1.754	0,24%	Selic	03-out-23	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	877	0,12%	Selic	03-out-23	6,00%	0,06%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2.627	0,36%	Selic	19-out-23	0,11%	0,11%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	4.371	0,60%	Selic	19-out-23	0,13%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	3.628	0,50%	Selic	02-out-23	0,12%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	874	0,12%	Selic	17-out-23	0,13%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2028-03-01	01-mar-28	1.749	0,24%	Selic	19-out-23	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT

