

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/09/2023

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 |
| Renda Fixa | 720.619,84 | 100% | | | 0,95% | 3,13% | 6,28% | 9,65% | 13,00% | 24,80% | 28,55% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |
| Renda Fixa CDI | 720.619,84 | 100% | | 0,01% | | | | | | | |
| BRADESCO FIRF REF. DI FEDERAL EXTRA | 720.619,84 | 100% | BRADESCO | 0,01% | 0,96% | 3,15% | 6,34% | 9,73% | 13,18% | 25,21% | 28,78% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |
| Total | 720.558,43 | 100% | | 0,01% | 0,95% | 3,13% | 6,28% | 9,65% | 13,00% | 24,80% | 28,55% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |

* 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.

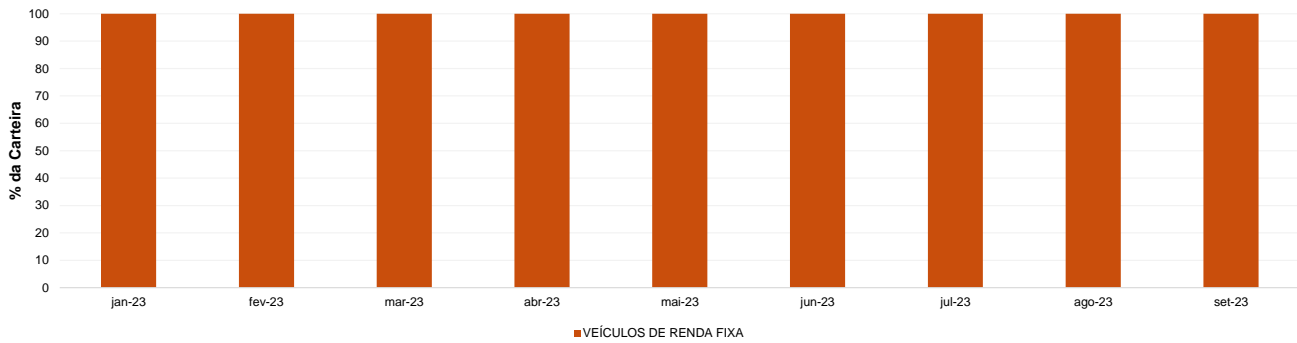
RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/09/2023

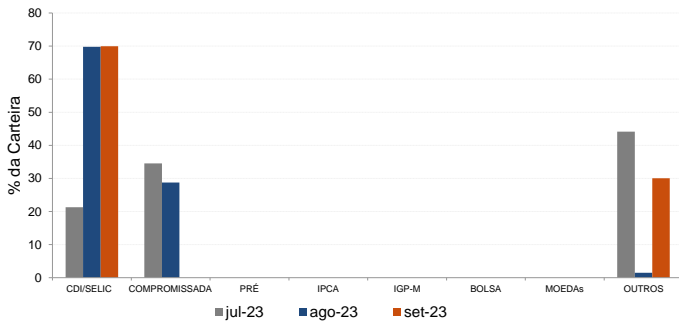
Distribuição da Carteira

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.

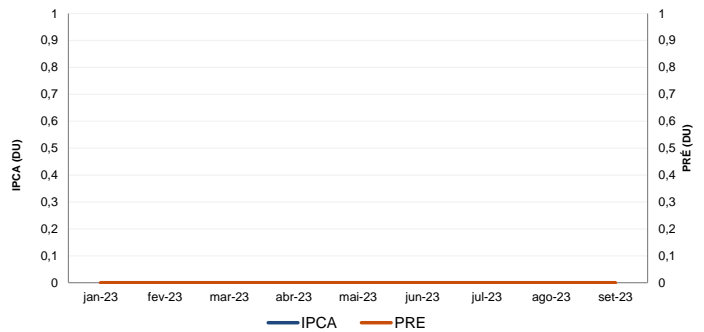
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 29/09/2023

Análises de Contrapartes

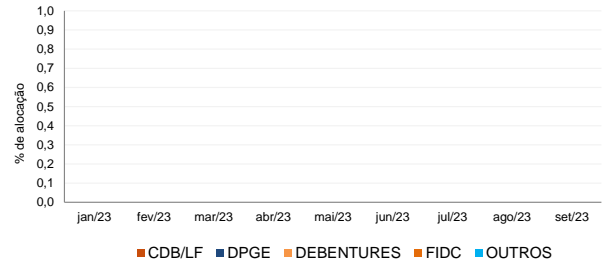
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do 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: 29/09/2023

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 | 9.531 | 1,32% | Selic | 01-set-23 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 4.765 | 0,66% | Selic | 01-set-23 | 0,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 3.812 | 0,53% | Selic | 01-set-23 | 0,01% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 952 | 0,13% | Selic | 22-set-23 | 5,00% | 0,00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-09-01 | 01-set-26 | 2.188 | 0,30% | Selic | 06-set-23 | 7,00% | 0,07% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2026-09-01 | 01-set-26 | 1.903 | 0,26% | Selic | 22-set-23 | 7,00% | 0,07% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 950 | 0,13% | Selic | 22-set-23 | 0,12% | 0,12% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |

