

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 31/10/2022

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	115.880.542,49	100%				1,04%			1,04%					
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	84.629.208,47	73,07%												
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF	84.629.208,47	73,07%		100%		1,02%	-	-	1,02%	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
RF CRÉDITO	20.219.827,59	17,46%												
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	6.884.913,13	5,94%	CA INDOSUEZ	6,01%		1,21%	3,83%	7,50%	12,43%	14,98%	23,21%	-		
ARX VINSON INSTITUC FC FI RF CRED PRIV	3.099.245,48	2,68%	ARX	1,23%		1,20%	-	-	-	-	-	-		
AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV	589.289,09	0,51%	AUGME	0,25%		1,23%	3,77%	7,58%	12,17%	14,23%	23,43%	28,92%		
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	7.927.187,28	6,84%	CAPITANIA CAPITAL	7,60%		1,03%	3,65%	7,22%	12,21%	13,96%	-	-		
CAPTALYS ORION FC FI MULT CRED PRIV	819.059,01	0,71%	CAPTALYS	0,06%		0,65%	-2,82%	0,50%	4,54%	6,27%	15,03%	26,93%		
MILENIO 180 FC FI MULT CRED PRIV	900.133,60	0,78%	MILENIO CAPITAL	1,15%		1,17%	4,26%	8,46%	13,33%	15,93%	27,99%	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
RF REFERENCIADO DI	10.649.132,44	9,19%												
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	10.649.132,44	9,19%	BRADESCO	0,12%		1,01%	3,25%	6,41%	9,75%	11,18%	14,81%	18,03%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
FIDC	382.373,99	0,33%												
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	21.632,67	0,02%	BNY MELLON	1,19%		1,33%	4,31%	8,54%	13,19%	15,19%	20,19%	25,25%		
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	58.183,87	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	302.557,45	0,26%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
Total	115.818.156,06	100%				0,02%	1,04%	3,34%	6,47%	11,16%	13,41%	17,51%	19,32%	
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,94%	1,06%	2,66%	8,60%	11,26%	28,63%	39,64%		

* 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.

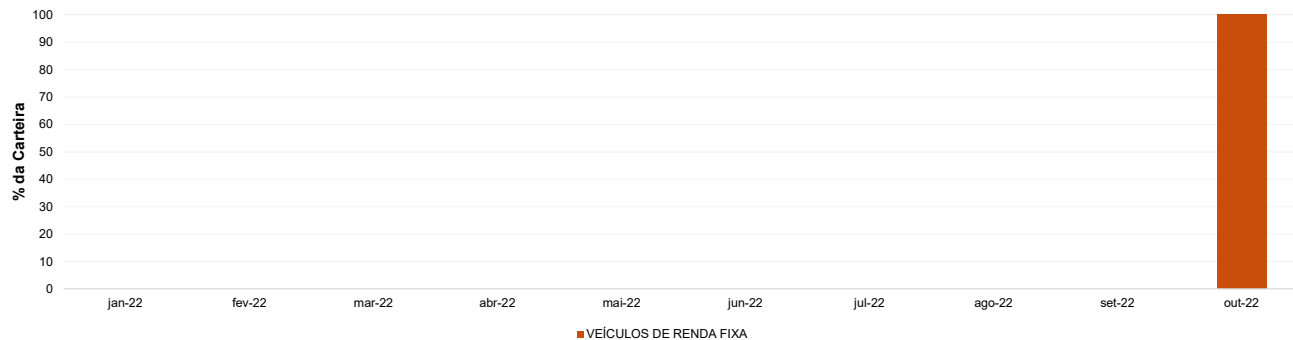
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

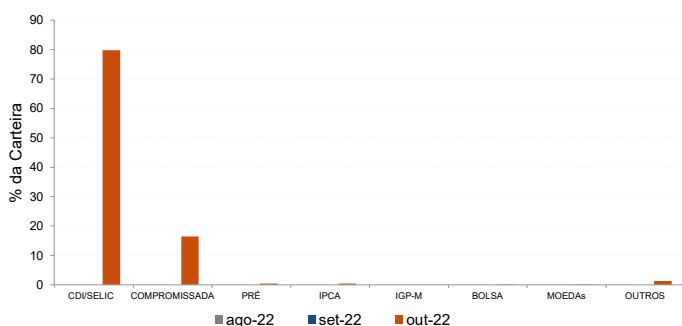
Distribuição da Carteira

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.

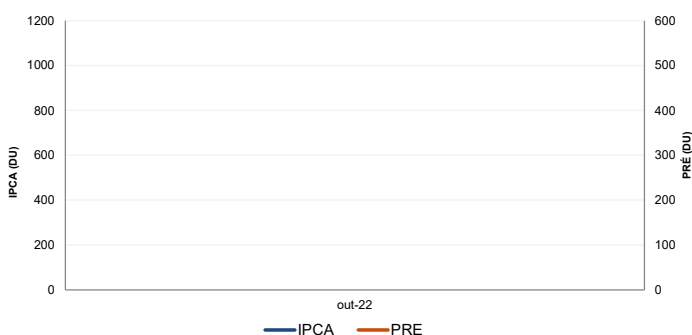
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VGIA15		0,04	100,00	0,00	

Liquidez da Carteira de Ações

A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

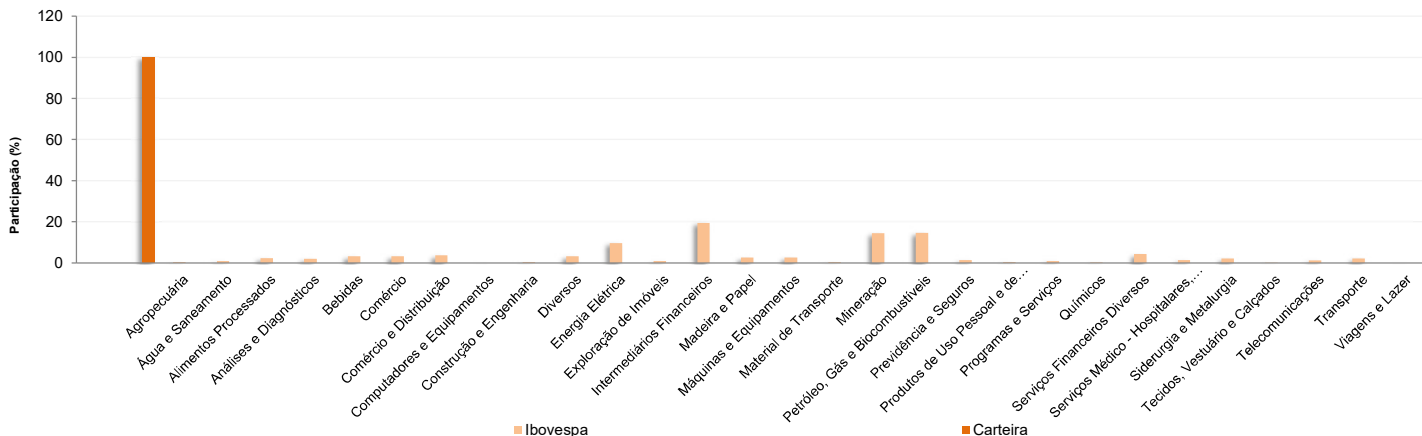
Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
------	--------	---	--------------	--------------------

* em mil R\$

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Análises de Contrapartes

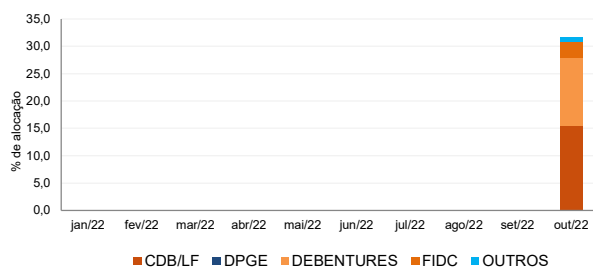
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.159,45	3,59	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.152,86	1,86	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.869,64	1,61	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.475,18	1,27	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	783,66	0,68	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	723,99	0,63	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	699,98	0,60	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	679,76	0,59	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	554,01	0,48	Faixa 2
BANCO CSF SA	504,81	0,44	Faixa 1

* 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
CSNAA2	75,03	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Sem Faixa	Faixa 1	20-dez-27	CDI	2,58%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
DASAA8	29,04	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-out-27	CDI	1,64%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
GUAR16	129,74	GUARARAPES CONFECÇÕES SA (EX CONFECÇO	Sem Faixa	Faixa 3	25-out-27	CDI	2,35%	CA INDOSEZ PENSION FI RF CRED PRIV
MRFGA0	4,22	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,47%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
MRFGA0	24,86	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,77%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RDORA5	21,47	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-32	CDI	2,05%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 31/10/2022

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
AALR13	04-out-27	86.599	0,07%	CDI	CENTRO IMAGEM DIAGNÓSTICOS S.A.	18-out-22	3,99%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
AALR13	04-out-27	8.839	0,01%	CDI	CENTRO IMAGEM DIAGNÓSTICOS S.A.	18-out-22	4,29%	Faixa 3	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
BRKPA0	15-abr-27	560	0,00%	CDI	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	06-out-22	2,18%	Faixa 3	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
CIEL16	20-set-25	358.009	0,31%	CDI	CIELO SA	03-out-22	1,23%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI I
CPTM15	15-set-30	178.102	0,15%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CPTM15	15-set-30	89.051	0,08%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CRA REIC 7 1	30-nov-26	1.329	0,00%	CDI	REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMO	10-out-22	6,67%	Sem Faixa	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
CSNAA2	20-dez-27	75.034	0,06%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	25-out-22	2,58%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ELDC14	20-set-24	1.687	0,00%	CDI	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	20-out-22	1,87%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
ENGIB7	20-out-29	260.210	0,22%	CDI	ENERGISA SA	20-out-22	1,65%	Faixa 1	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
GUAR16	25-out-27	129.740	0,11%	CDI	GUARARAPES CONFECCOES SA (EX COF)	31-out-22	2,35%	Faixa 3	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
ITPO14	15-nov-36	43.287	0,04%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	26-out-22	7,70%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LF CDI	07-out-24	50.462	0,04%	CDI	BANCO MODAL SA	06-out-22	1,70%	Faixa 3	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI I
LF CDI	13-out-26	50.403	0,04%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	11-out-22	1,20%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI I
MEAL21	15-mar-26	1.207	0,00%	CDI	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMEN	27-out-22	6,19%	Faixa 4	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD25	13-set-29	7.401	0,01%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,60%	Faixa 1	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD35	13-set-32	38.475	0,03%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,98%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OCNP13	08-nov-26	1.868	0,00%	CDI	OCEANPACT SERVICOS MARITIMOS S.A.	19-out-22	3,86%	Sem Faixa	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
RDORA5	15-out-32	21.474	0,02%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	19-out-22	2,05%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SSED21	15-ago-23	2.845	0,00%	CDI	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	06-out-22	1,52%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
UNEG11	15-jul-39	52.921	0,05%	IPCA	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	21-out-22	7,52%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	242.215	0,21%	Selic		06-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	20	0,00%	Selic		06-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	88.077	0,08%	Selic		31-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	44	0,00%	Selic		03-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	7	0,00%	Selic		31-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		03-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	73.397	0,06%	Selic		04-out-22	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	49.462	0,04%	Selic		17-out-22	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI I
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6	0,00%	Selic		04-out-22	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	26.339	0,02%	Selic		27-out-22	0,10%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2	0,00%	Selic		27-out-22	0,10%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	54.116	0,05%	Selic		27-out-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	4	0,00%	Selic		27-out-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	20.427	0,02%	Selic		27-out-22	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2	0,00%	Selic		27-out-22	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT