

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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		
<b>Renda Fixa</b>	<b>94.586.105,80</b>	<b>72,77%</b>				<b>1,14%</b>			<b>1,14%</b>					
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>54.960.449,25</b>	<b>42,28%</b>												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	54.960.449,25	42,28%		100%		1,15%	-	-	1,15%	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
<b>RF CRÉDITO</b>	<b>20.355.938,11</b>	<b>15,66%</b>												
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	7.381.820,93	5,68%	CA INDOSUEZ	6,45%		1,21%	3,83%	7,50%	12,43%	14,98%	23,21%	-		
ARX VINSON INSTITUC FC FI RF CRED PRIV	8.715.391,67	6,70%	ARX	3,46%		1,20%	-	-	-	-	-	-		
AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV	880.048,67	0,68%	AUGME	0,38%		1,23%	3,77%	7,58%	12,17%	14,23%	23,43%	28,92%		
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2.101.444,83	1,62%	CAPITANIA CAPITAL	2,02%		1,03%	3,65%	7,22%	12,21%	13,96%	-	-		
CAPTALYS ORION FC FI MULT CRED PRIV	613.555,37	0,47%	CAPTALYS	0,04%		0,65%	-2,82%	0,50%	4,54%	6,27%	15,03%	26,93%		
MILENIO 180 FC FI MULT CRED PRIV	663.676,63	0,51%	MILENIO CAPITAL	0,85%		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%		
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>14.345.395,71</b>	<b>11,04%</b>												
GERI TENAX FI RF LP	2.018.670,49	1,55%	TENAX CAPITAL	4,91%		1,04%	3,59%	4,86%	8,20%	11,81%	10,01%	11,94%		
PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP	6.160.011,87	4,74%	PACIFICO	4,53%		0,97%	3,62%	3,98%	6,65%	9,80%	-	-		
ITAU GERI RF FI	6.166.713,36	4,74%	ITAU	13,63%		1,09%	3,89%	4,82%	8,62%	11,53%	2,64%	1,78%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
<b>RF</b>	<b>4.417.209,11</b>	<b>3,40%</b>												
ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.417.209,11	3,40%	ITAU	0,25%		1,11%	2,86%	5,32%	9,50%	11,83%	16,45%	22,73%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
<b>FIDC</b>	<b>507.113,63</b>	<b>0,39%</b>												
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	64.607,04	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	424.077,66	0,33%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.428,93	0,01%	BNY MELLON	1,01%		1,33%	4,31%	8,54%	13,19%	15,19%	20,19%	25,25%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
<b>Renda Variável</b>	<b>7.956.660,07</b>	<b>6,12%</b>				<b>5,84%</b>			<b>5,84%</b>					
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					5,70%	13,33%	9,19%	13,45%	15,48%	31,00%	18,20%		
<b>RV VALOR</b>	<b>3.506.440,04</b>	<b>2,70%</b>												
BOGARI VALUE T INSTITUCIONAL FC FIA	1.288.388,57	0,99%	BOGARI	4,02%		6,72%	11,94%	1,39%	-8,87%	-12,33%	-	-		
KIRON INSTITUCIONAL FIA	496.895,71	0,38%	KIRON CAPITAL	0,86%		10,78%	20,23%	18,10%	23,24%	23,29%	14,48%	10,59%		
LIS VALUE FIA	408.855,58	0,31%	LIS CAPITAL	0,15%		3,23%	12,68%	1,85%	-3,27%	1,52%	11,23%	35,52%		
MCTAG FC FIA	672.289,39	0,52%	MOAT CAPITAL	1,78%		3,33%	11,19%	7,53%	5,10%	10,88%	4,58%	-		
VELT INSTITUCIONAL FC DE FIA	640.010,79	0,49%	VELT PARTNES	0,25%		3,61%	13,42%	4,09%	-6,27%	-12,64%	-16,44%	-15,63%		
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%		
<b>RV PASSIVO</b>	<b>2.590.664,88</b>	<b>1,99%</b>												
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	2.590.664,88	1,99%	BLACKROCK	0,02%		5,34%	12,94%	8,46%	11,26%	12,51%	23,70%	8,64%		
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%		
<b>RV LONG BIAS</b>	<b>808.697,18</b>	<b>0,62%</b>												
SHARP LONG BIASED FC FI MULT	808.697,18	0,62%	SHARP	1,31%		5,70%	11,70%	12,55%	16,95%	14,52%	21,80%	-		
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%		
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>619.846,13</b>	<b>0,48%</b>												
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FIA	619.846,13	0,48%	AZ QUEST	0,05%		8,89%	12,88%	3,14%	3,12%	1,30%	11,17%	4,12%		
Benchmark:	SMML					7,30%	16,81%	0,91%	-1,35%	0,06%	3,68%	-2,72%		
<b>RV ATIVO</b>	<b>388.132,99</b>	<b>0,30%</b>												
AZ QUEST ACOES FC FIA	388.132,99	0,30%	AZ QUEST	0,11%		6,11%	12,85%	6,11%	9,26%	6,93%	7,23%	-6,26%		
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%		
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>42.878,84</b>	<b>0,03%</b>												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	42.878,84	0,03%		58,36%		5,34%	-	-	5,34%	-	-	-		
Benchmark:	IBX					5,57%	12,01%	6,76%	10,25%	11,78%	23,41%	9,78%		
<b>Estruturado</b>	<b>21.468.725,65</b>	<b>16,52%</b>				<b>2,47%</b>			<b>2,47%</b>					
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,26%	4,07%	8,12%	12,73%	14,84%	22,18%	29,88%		

\* 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 PERFIL MODERADO 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	
<b>MM MACRO</b>	<b>14.637.966,52</b>	<b>11,26%</b>											
ITAU INST OPTIMUS TITAN MULT FC	4.399.578,81	3,38%	ITAU	2,86%		2,11%	5,37%	10,45%	18,25%	20,40%	-	-	
ITAU INSTIT MACRO OPPORTUNITIES MULT FC	2.626.433,86	2,02%	ITAU	1,36%		-0,67%	4,56%	6,91%	20,04%	20,43%	23,70%	-	
IBIUNA HEDGE STH FC DE FI MULT	321.175,77	0,25%	IBIUNA	0,01%		1,97%	8,36%	7,08%	20,65%	21,53%	35,83%	55,99%	
SOLANA EQUITY HEDGE VIII FC FI MULT	991.792,48	0,76%	SOLANA	1,41%		2,64%	15,71%	15,85%	17,05%	22,13%	-	-	
CLAVE ALPHA MACRO II FC MULT	282.495,50	0,22%	CLAVE	0,08%		3,78%	6,31%	7,58%	-	-	-	-	
F35 LIGHTNING FICFI MULT	1.397.679,00	1,08%	SPX	2,52%		-0,89%	6,42%	9,14%	27,85%	30,17%	41,60%	51,04%	
GENOA TL FC FI MULT	964.949,29	0,74%	GENOA	1,06%		2,08%	6,53%	11,31%	19,96%	22,25%	38,60%	-	
KAPITALO ZETA FC DE FI MULT	648.711,65	0,50%	KAPITALO	0,03%		2,10%	3,44%	8,26%	16,79%	19,32%	45,52%	32,01%	
NW3 EVENT DRIVEN PLUS FICFI MULT	418.501,40	0,32%	NW3	0,13%		2,19%	5,62%	8,68%	15,42%	17,56%	23,63%	19,11%	
RPS TOTAL RETURN FC FI MULT D30 TAG	657.589,62	0,51%	RPS CAPITAL	1,73%		-3,59%	-1,27%	2,19%	5,10%	4,32%	15,45%	-	
CLAVE ALPHA MACRO FC MULT	667.323,84	0,51%	CLAVE	0,24%		3,76%	6,30%	7,59%	15,90%	20,37%	31,76%	-	
VISTA HEDGE D30 FC FI MULT	620.381,55	0,48%	VISTA	0,12%		0,69%	-4,24%	1,29%	-	-	-	-	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	641.353,76	0,49%	ZEITGEIST	0,03%		-0,04%	2,85%	3,91%	10,64%	10,20%	24,26%	31,25%	
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%	
<b>MM FIC</b>	<b>6.830.759,13</b>	<b>5,25%</b>											
ITAU GLOBAL DINAMICO ULTRA MULT FC	2.385.940,07	1,84%	ITAU	0,69%		1,55%	4,99%	9,08%	18,36%	18,49%	-	-	
ITAU INFLATION EQUITY OPPORT MULT FC	4.444.819,06	3,42%	ITAU	1,22%		8,11%	11,25%	6,56%	19,12%	22,85%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%	
<b>Exterior</b>	<b>5.276.199,21</b>	<b>4,06%</b>				<b>-2,81%</b>			<b>-2,81%</b>				
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					4,14%	-6,01%	-2,61%	-25,74%	-25,24%	1,20%	49,76%	
<b>MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>5.276.199,21</b>	<b>4,06%</b>											
CARTEIRA ITAU INT INST FC MULT IE	534.170,96	0,41%	ITAU	0,96%		-1,42%	-8,11%	-5,51%	-23,72%	-23,72%	-	-	
TAG MULT ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.742.028,25	3,65%	TAG INVEST	9,20%		-2,97%	-2,99%	-0,34%	-21,07%	-20,96%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%	
<b>Total</b>	<b>129.987.563,56</b>	<b>100%</b>				<b>1,09%</b>	<b>1,47%</b>	<b>4,20%</b>	<b>5,64%</b>	<b>9,92%</b>	<b>12,38%</b>	<b>15,81%</b>	<b>15,92%</b>
Benchmark:	IPCA + 5,5% a.a.					1,02%	1,31%	3,16%	9,46%	12,33%	31,10%	43,66%	

\* 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.

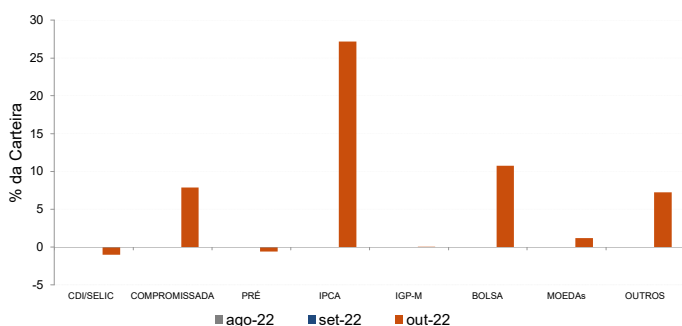
## Distribuição da Carteira

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.

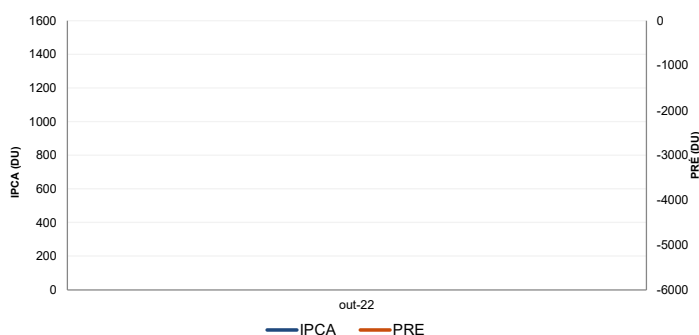
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
ELET3	Energia Elétrica	679,94	4,79	0,00	
ENGI11	Energia Elétrica	597,07	4,21	0,00	
VALE3	Mineração	502,93	3,54	0,00	
RENT3	Diversos	461,68	3,25	0,00	
EQTL3	Energia Elétrica	449,45	3,17	0,00	
IGTI11	Exploração de Imóveis	447,64	3,15	0,00	
ITUB4	Intermediários Financeiros	435,00	3,07	0,00	
RAIL3	Transporte	427,14	3,01	0,00	
SBSP3	Água e Saneamento	410,26	2,89	0,00	
SHV US		362,06	2,55	0,00	

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

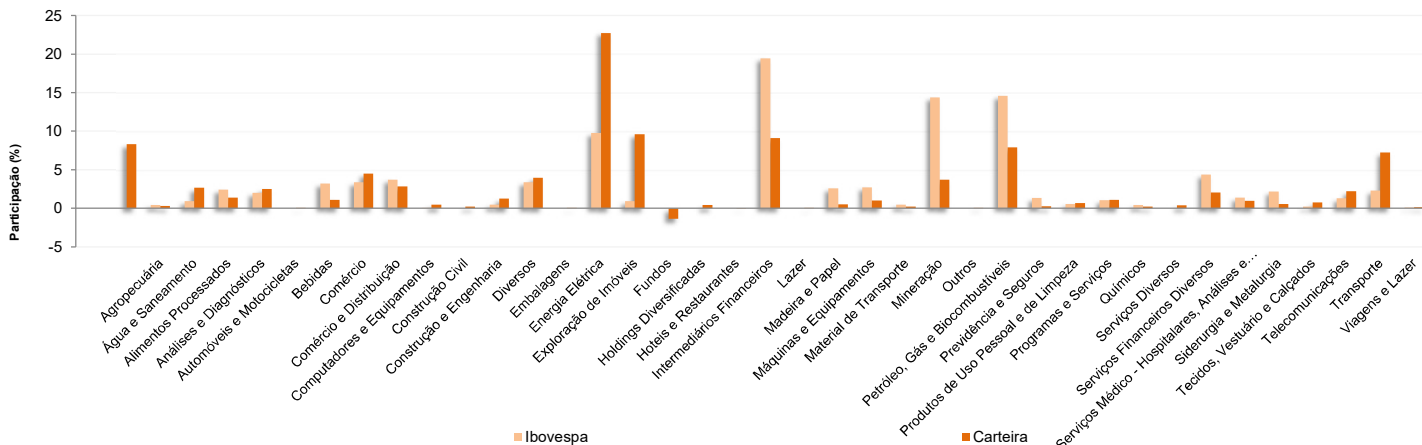
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	24,38	0,17	0,02	11
MTSA4	31,91	0,22	0,02	2
SCAR3	27,64	0,19	0,00	2
ELET3	679,94	4,79	0,00	1
ENGI11	597,07	4,21	0,00	1
VALE3	502,93	3,54	0,00	1
RENT3	461,68	3,25	0,00	1
EQTL3	449,45	3,17	0,00	1
IGTI11	447,64	3,15	0,00	1
ITUB4	435,00	3,07	0,00	1

\* 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

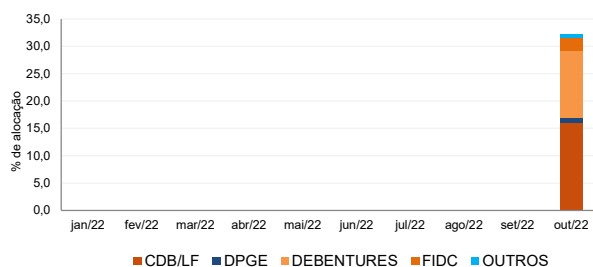
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.457,12	5,01	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.781,50	2,16	Faixa 1
BCO ITAU SA	2.331,47	1,81	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.589,45	1,23	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.275,55	0,99	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.185,86	0,92	Faixa 4
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.137,73	0,88	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.040,11	0,81	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	1.033,50	0,80	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.016,14	0,79	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	19,89	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Sem Faixa	Faixa 1	20-dez-27	CDI	2,58%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
DASAA8	81,66	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-out-27	CDI	1,64%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
GUAR16	139,10	GUARARAPES CONFECOES SA (EX CONFECOEC	Sem Faixa	Faixa 3	25-out-27	CDI	2,35%	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV
MRFGA0	11,85	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,47%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
MRFGA0	69,92	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,77%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RDORA5	5,69	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 MODERADO 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	22.957	0,02%	CDI	CENTRO IMAGEM DIAGNÓSTICOS S.A.	18-out-22	3,99%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
AALR13	04-out-27	13.200	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	836	0,00%	CDI	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	06-out-22	2,18%	Faixa 3	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
CPTM15	15-set-30	47.214	0,04%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CPTM15	15-set-30	23.607	0,02%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CRA REIC 7 1	30-nov-26	1.985	0,00%	CDI	REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMO	10-out-22	6,67%	Sem Faixa	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
CSNAA2	20-dez-27	19.891	0,02%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	25-out-22	2,58%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ELDC14	20-set-24	2.520	0,00%	CDI	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	20-out-22	1,87%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
ENGB7	20-out-29	278.990	0,22%	CDI	ENERGISA SA	20-out-22	1,65%	Faixa 1	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
GUAR16	25-out-27	139.104	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	11.475	0,01%	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 MODERADO RAI CP F
MEAL21	15-mar-26	1.802	0,00%	CDI	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMET	27-out-22	6,19%	Faixa 4	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD25	13-set-29	11.053	0,01%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,60%	Faixa 1	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD35	13-set-32	10.199	0,01%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,98%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OCNP13	08-nov-26	2.789	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	5.693	0,00%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	19-out-22	2,05%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SSED21	15-ago-23	4.249	0,00%	CDI	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	06-out-22	1,52%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
UNEG11	15-jul-39	14.029	0,01%	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		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-09-01	01-set-24	308.845	0,24%	Selic		18-out-22	0,02%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-09-01	01-set-24	119.518	0,09%	Selic		18-out-22	0,02%	0,00%	ITAU GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	15.150	0,01%	Selic		28-out-22	0,01%	0,00%	ITAU GERI RF FI
LTN 2026-01-01	01-jan-26	367.565	0,29%	PRE		10-out-22	11,60%	11,51%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-01-01	01-jan-26	66.831	0,05%	PRE		10-out-22	11,54%	11,51%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-01-01	01-jan-26	8.688	0,01%	PRE		03-out-22	11,67%	11,47%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	70.127	0,05%	IPCA		24-out-22	6,33%	6,17%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	12.490	0,01%	IPCA		28-out-22	5,96%	5,97%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	4.022	0,00%	IPCA		14-out-22	6,42%	6,34%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.419	0,00%	IPCA		28-out-22	5,97%	5,97%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	911.426	0,71%	IPCA		31-out-22	5,54%	5,38%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	250.072	0,19%	IPCA		31-out-22	5,54%	5,38%	ITAU GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	61.862	0,05%	IPCA		19-out-22	5,71%	5,63%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	4.082	0,00%	IPCA		14-out-22	5,67%	5,69%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	126.646	0,10%	IPCA		24-out-22	5,65%	0,00%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	3.383	0,00%	IPCA		18-out-22	5,66%	0,00%	ITAU GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	396.681	0,31%	IPCA		04-out-22	5,63%	5,69%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	47.344	0,04%	IPCA		17-out-22	5,75%	5,69%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	20.447	0,02%	IPCA		26-out-22	5,73%	5,78%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	18.025	0,01%	IPCA		10-out-22	5,73%	5,74%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	202.065	0,16%	IPCA		07-out-22	5,57%	5,69%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	4.113	0,00%	IPCA		14-out-22	5,71%	5,72%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	2.779	0,00%	IPCA		07-out-22	5,67%	5,69%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	1.859	0,00%	IPCA		06-out-22	5,62%	5,67%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	9.620.313	7,46%	IPCA		18-out-22	5,77%	5,76%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	45.470	0,04%	IPCA		13-out-22	5,82%	5,82%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	23.123	0,02%	IPCA		19-out-22	5,75%	5,76%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	23.113	0,02%	IPCA		19-out-22	5,76%	5,76%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	15.388	0,01%	IPCA		10-out-22	5,77%	5,79%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	1.676	0,00%	IPCA		18-out-22	5,77%	5,76%	ITAU GERI RF FI
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	569	0,00%	IPCA		18-out-22	5,77%	5,77%	ITAU GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	71.111	0,06%	IPCA		24-out-22	5,82%	5,85%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	2.260	0,00%	IPCA		18-out-22	5,83%	0,00%	ITAU GERI RF FI