

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	4.623.972,61	100%				1,07%			1,45%					
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
Multiestatégia	4.623.972,61	100%			0,01%									
ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI	1.609.339,86	34,80%	ITAU	0,05%	0,01%	1,12%	3,67%	7,37%	11,33%	13,08%	18,14%	21,49%		
ITAU VERSO A RF REF DI FI	3.014.632,75	65,19%	ITAU	0,01%	0,01%	1,04%	3,34%	6,60%	10,16%	11,67%	15,52%	19,04%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		
Total	4.624.592,37	100%			0,01%	1,05%			2,28%					
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%		

* 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.

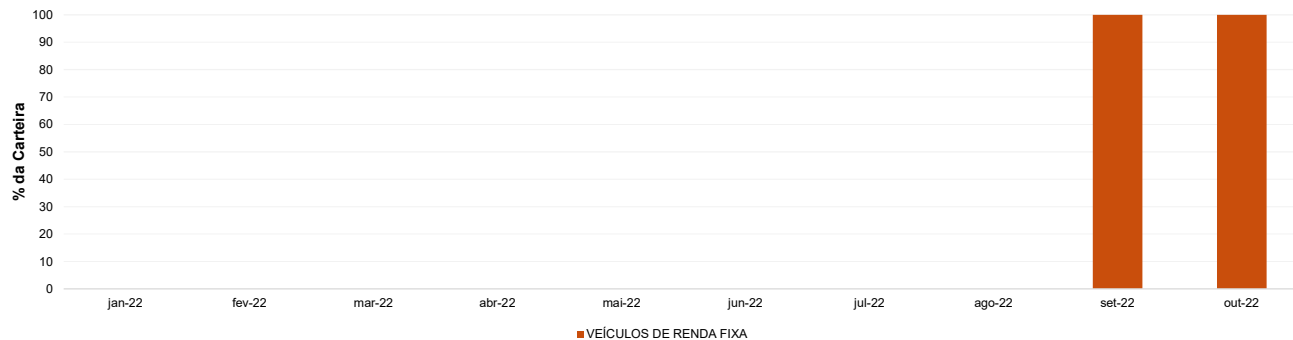
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

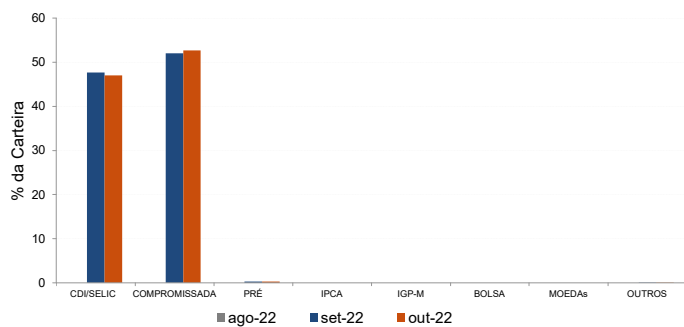
Distribuição da Carteira

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.

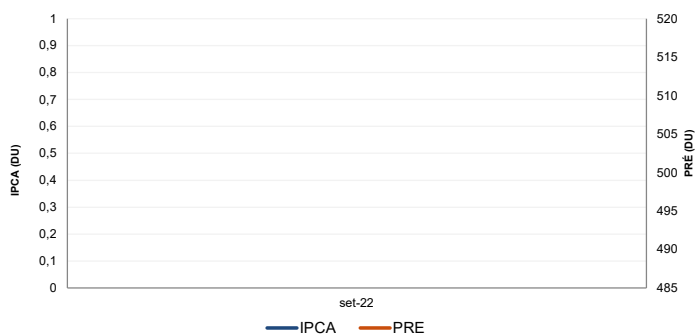
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

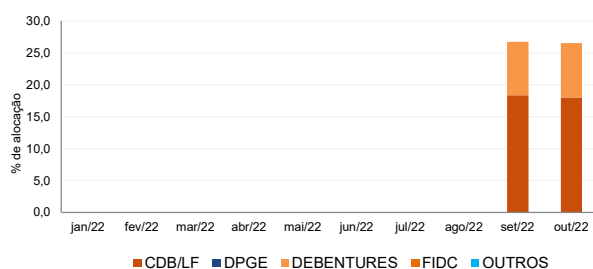
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	211,46	4,64	Faixa 1
BCO ITAU SA	108,51	2,38	Faixa 1
BCO SAFRA SA	97,52	2,14	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	59,80	1,31	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	50,44	1,11	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	49,56	1,09	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	48,52	1,06	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	30,21	0,66	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	28,31	0,62	Faixa 2
BANCO XP S.A	27,55	0,60	Faixa 2

* 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.								

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
ALGA18	15-fev-24	118	0,00%	CDI	ALGAR TELECOM SA	17-out-22	0,94%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
ALGA18	15-fev-24	97	0,00%	CDI	ALGAR TELECOM SA	17-out-22	0,94%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
BSA315	24-mai-24	222	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	17-out-22	1,10%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
BSA315	24-mai-24	160	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	17-out-22	1,10%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
BSA325	24-mai-26	179	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	17-out-22	1,20%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
CIEL16	20-set-25	17.718	0,39%	CDI	CIELO SA	03-out-22	1,23%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
CIEL16	20-set-25	132	0,00%	CDI	CIELO SA	04-out-22	1,23%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LCAMA9	15-jan-26	1.270	0,03%	CDI	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	17-out-22	1,85%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-23	2.292	0,05%	CDI	BANCO XP S.A	13-out-22	0,68%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-23	1.003	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	13-out-22	0,68%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-23	974	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	13-out-22	0,68%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-23	401	0,01%	CDI	BANCO XP S.A	13-out-22	0,68%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-23	372	0,01%	CDI	BANCO XP S.A	13-out-22	0,68%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	04-set-23	85	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,66%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	27-nov-23	56	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	0,95%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-dez-23	56	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	0,95%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	24-jan-24	166	0,00%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	17-out-22	1,07%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	14-fev-24	370	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-out-22	0,92%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	14-mar-24	370	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-out-22	0,93%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	25-mar-24	81	0,00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	17-out-22	0,87%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	09-abr-24	162	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	0,97%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	19-abr-24	174	0,00%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	17-out-22	1,12%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	06-mai-24	635	0,01%	CDI	BCO SAFRA SA	05-out-22	0,82%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	13-mai-24	493	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-out-22	0,96%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	27-mai-24	58	0,00%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	17-out-22	0,76%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	31-mai-24	86	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,79%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	10-jun-24	86	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,80%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-jun-24	494	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-out-22	0,98%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	24-jun-24	86	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,81%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jun-24	258	0,01%	CDI	BANCO XP S.A	05-out-22	0,85%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-ago-24	114	0,00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	17-out-22	0,98%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-ago-24	109	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,83%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-set-24	85	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,84%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	07-out-24	1.995	0,04%	CDI	BANCO MODAL SA	06-out-22	1,70%	Faixa 3	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	16-out-24	29	0,00%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	17-out-22	1,01%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	04-nov-24	1	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	05-out-22	0,86%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	25-nov-24	56	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	1,03%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-dez-24	56	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	1,04%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	18-mar-25	108	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	1,06%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	25-mar-25	81	0,00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	17-out-22	1,07%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-abr-25	87	0,00%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	17-out-22	1,31%	Faixa 2	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-abr-25	54	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	17-out-22	1,03%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	29-abr-25	107	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	17-out-22	1,06%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-ago-25	85	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	17-out-22	0,99%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	29-jun-26	747	0,02%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-out-22	0,96%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	18-nov-30	893	0,02%	CDI	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	17-out-22	1,71%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	03-nov-31	342	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-out-22	2,12%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	12-abr-50	2.123	0,05%	CDI	BCO BRADESCO SA	13-out-22	3,00%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	12-abr-50	327	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-out-22	3,00%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-ago-50	176	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-out-22	3,31%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
YDUQ16	18-fev-26	7.572	0,17%	CDI	YDUQS PARTICIPACOES SA	25-out-22	1,78%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.545	0,03%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	765	0,02%	Selic	25-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	537	0,01%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	383	0,01%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	15	0,00%	Selic	25-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.917	0,04%	Selic	19-out-22	0,01%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	383	0,01%	Selic	19-out-22	0,01%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	308	0,01%	Selic	10-out-22	0,01%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	229	0,01%	Selic	19-out-22	0,01%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	764	0,02%	Selic	27-out-22	0,01%	0,00%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	19.146	0,42%	Selic	24-out-22	4,00%	0,04%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	24	0,00%	Selic	20-out-22	0,10%	0,00%	ITAU VERSO A RF REF DI FI