

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV 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	223.739.979,60	86,36%				1,07%			1,07%						
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%			
CARTEIRA PRÓPRIA RF	147.150.909,62	56,80%													
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF RAI	147.150.909,62	56,80%			100%	1,05%	-	-	1,05%	-	-	-			
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%			
RF CRÉDITO	42.187.525,16	16,28%													
ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI	1.609.339,86	0,62%	ITAU	0,05%		1,12%	3,67%	7,37%	11,33%	13,08%	18,14%	21,49%			
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	14.266.734,07	5,51%	CA INDOSUEZ	12,46%		1,21%	3,83%	7,50%	12,43%	14,98%	23,21%	-			
ARX VINSON INSTITUC FC FI RF CRED PRIV	11.814.637,15	4,56%	ARX	4,68%		1,20%	-	-	-	-	-	-			
AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV	1.469.337,76	0,57%	AUGME	0,63%		1,23%	3,77%	7,58%	12,17%	14,23%	23,43%	28,92%			
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	10.028.632,11	3,87%	CAPITANIA CAPITAL	9,62%		1,03%	3,65%	7,22%	12,21%	13,96%	-	-			
CAPTALYS ORION FC FI MULT CRED PRIV	1.435.232,81	0,55%	CAPTALYS	0,10%		0,65%	-2,82%	0,50%	4,54%	6,27%	15,03%	26,93%			
MILENIO 180 FC FI MULT CRED PRIV	1.563.611,40	0,60%	MILENIO CAPITAL	2,00%		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	29.094.848,09	11,23%													
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.085.687,19	0,42%	BRADESCO	0,03%		1,03%	3,35%	6,63%	10,10%	11,59%	15,42%	18,81%			
ITAU VERSO A RF REF DI FI	3.014.632,75	1,16%	ITAU	0,01%		1,04%	3,34%	6,60%	10,16%	11,67%	15,52%	19,04%			
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	10.649.132,44	4,11%	BRADESCO	0,12%		1,01%	3,25%	6,41%	9,75%	11,18%	14,81%	18,03%			
GERI TENAX FI RF LP	2.018.670,49	0,78%	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	2,38%	PACIFICO	4,53%		0,97%	3,62%	3,98%	6,65%	9,80%	-	-			
ITAU GERI RF FI	6.166.713,36	2,38%	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%			
RF	4.417.209,11	1,70%													
ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.417.209,11	1,70%	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%			
FIDC	889.487,63	0,34%													
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	40.061,61	0,02%	BNY MELLON	2,20%		1,33%	4,31%	8,54%	13,19%	15,19%	20,19%	25,25%			
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	122.790,91	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-			
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	726.635,11	0,28%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-			
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%			
Renda Variável	7.956.734,59	3,07%				5,84%			5,84%						
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					5,70%	13,33%	9,19%	13,45%	15,48%	31,00%	18,20%			
RV VALOR	3.506.440,04	1,35%													
BOGARI VALUE T INSTITUCIONAL FC FIA	1.288.388,57	0,50%	BOGARI	4,02%		6,72%	11,94%	1,39%	-8,87%	-12,33%	-	-			
KIRON INSTITUCIONAL FIA	496.895,71	0,19%	KIRON CAPITAL	0,86%		10,78%	20,23%	18,10%	23,24%	23,29%	14,48%	10,59%			
LIS VALUE FIA	408.855,58	0,16%	LIS CAPITAL	0,15%		3,23%	12,68%	1,85%	-3,27%	1,52%	11,23%	35,52%			
MCTAG FC FIA	672.289,39	0,26%	MOAT CAPITAL	1,78%		3,33%	11,19%	7,53%	5,10%	10,88%	4,58%	-			
VELT INSTITUCIONAL FC DE FIA	640.010,79	0,25%	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%			
RV PASSIVO	2.590.664,88	1,00%													
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	2.590.664,88	1,00%	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%			
RV LONG BIAS	808.697,18	0,31%													
SHARP LONG BIASED FC FI MULT	808.697,18	0,31%	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%			
RV SMALL CAP	619.846,13	0,24%													
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FIA	619.846,13	0,24%	AZ QUEST	0,05%		8,89%	12,88%	3,14%	3,12%	1,30%	11,17%	4,12%			
Benchmark:	SMLL					7,30%	16,81%	0,91%	-1,35%	0,06%	3,68%	-2,72%			
RV ATIVO	388.132,99	0,15%													
AZ QUEST ACOES FC FIA	388.132,99	0,15%	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%			
CARTEIRA PRÓPRIA RV	42.953,36	0,02%													
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RV RAI	42.953,36	0,02%			58,52%	5,34%	-	-	5,34%	-	-	-			
Benchmark:	IBX					5,57%	12,01%	6,76%	10,25%	11,78%	23,41%	9,78%			
Estruturado	21.468.725,65	8,29%				2,47%			2,47%						
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 PLANO CV 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
MM MACRO	14.637.966,52	5,65%										
ITAU INST OPTIMUS TITAN MULT FC	4.399.578,81	1,70%	ITAU	2,86%		2,11%	5,37%	10,45%	18,25%	20,40%	-	-
ITAU INSTIT MACRO OPPORTUNITIES MULT FC	2.626.433,86	1,01%	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	0,12%	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	0,38%	SOLANA	1,41%		2,64%	15,71%	15,85%	17,05%	22,13%	-	-
CLAVE ALPHA MACRO II FC MULT	282.495,50	0,11%	CLAVE	0,08%		3,78%	6,31%	7,58%	-	-	-	-
F35 LIGHTNING FICFI MULT	1.397.679,00	0,54%	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	0,37%	GENOA	1,06%		2,08%	6,53%	11,31%	19,96%	22,25%	38,60%	-
KAPITALO ZETA FC DE FI MULT	648.711,65	0,25%	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	0,16%	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	0,25%	RPS CAPITAL	1,73%		-3,59%	-1,27%	2,19%	5,10%	4,32%	15,45%	-
CLAVE ALPHA MACRO FC MULT	667.323,84	0,26%	CLAVE	0,24%		3,76%	6,30%	7,59%	15,90%	20,37%	31,76%	-
VISTA HEDGE D30 FC FI MULT	620.381,55	0,24%	VISTA	0,12%		0,69%	-4,24%	1,29%	-	-	-	-
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	641.353,76	0,25%	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%
MM FIC	6.830.759,13	2,64%										
ITAU GLOBAL DINAMICO ULTRA MULT FC	2.385.940,07	0,92%	ITAU	0,69%		1,55%	4,99%	9,08%	18,36%	18,49%	-	-
ITAU INFLATION EQUITY OPPORT MULT FC	4.444.819,06	1,72%	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%
Exterior	5.276.199,21	2,04%				-2,81%			-2,81%			
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					4,14%	-6,01%	-2,61%	-25,74%	-25,24%	1,20%	49,76%
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.276.199,21	2,04%										
CARTEIRA ITAU INT INST FC MULT IE	534.170,96	0,21%	ITAU	0,96%		-1,42%	-8,11%	-5,51%	-23,72%	-23,72%	-	-
TAG MULT ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.742.028,25	1,83%	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%
Total	259.073.933,34	100%			0,55%	1,24%	3,71%	5,99%	10,52%	12,92%	17,40%	18,36%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,93%	1,03%	2,61%	8,50%	11,14%	28,36%	39,20%

* 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.

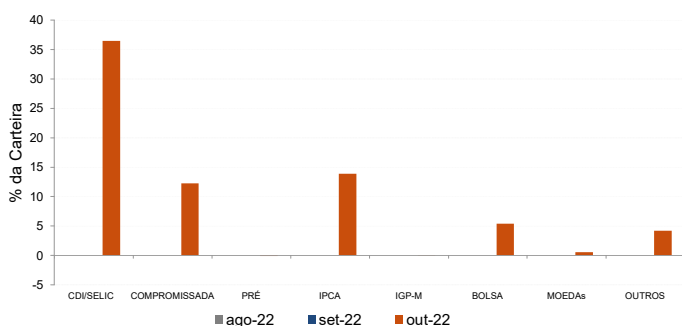
Distribuição da Carteira

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.

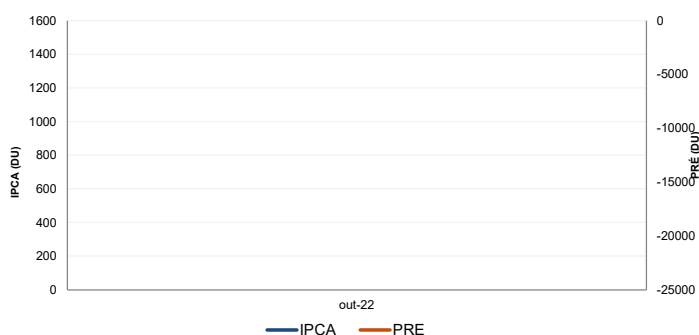
Evolução do Patrimônio Líquido



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	677,97	4,78	0,00	
ENGI11	Energia Elétrica	597,12	4,21	0,00	
VALE3	Mineração	515,95	3,64	0,00	
RENT3	Diversos	457,53	3,23	0,00	
EQTL3	Energia Elétrica	449,58	3,17	0,00	
IGTI11	Exploração de Imóveis	447,62	3,16	0,00	
ITUB4	Intermediários Financeiros	429,58	3,03	0,00	
RAIL3	Transporte	425,21	3,00	0,00	
SBSP3	Água e Saneamento	405,48	2,86	0,00	
SHV US		362,06	2,55	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

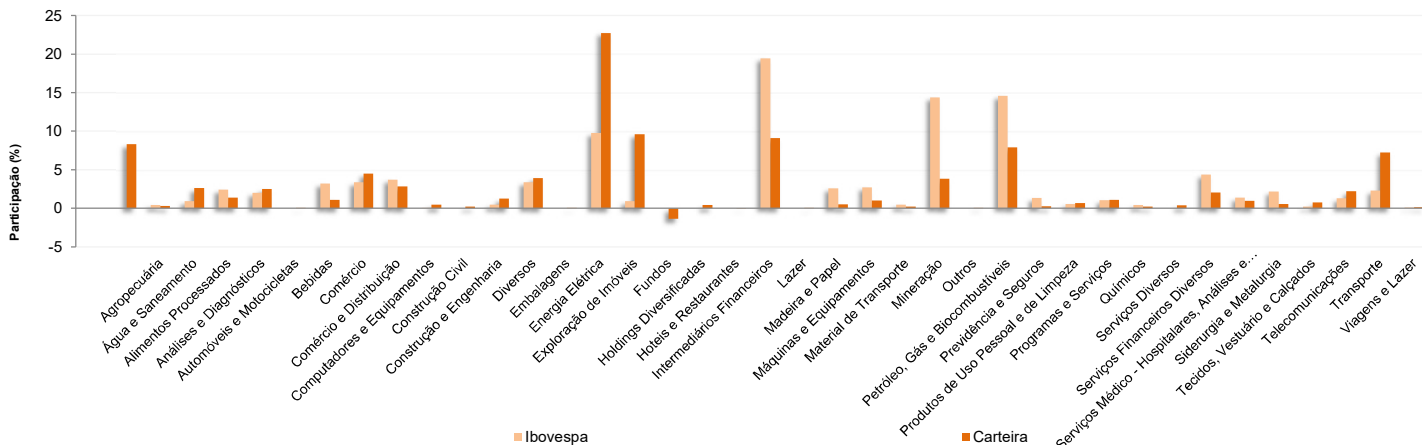
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	24,38	0,17	0,02	11
MTSA4	31,91	0,23	0,02	2
SCAR3	27,64	0,19	0,00	2
ELET3	677,97	4,78	0,00	1
ENGI11	597,12	4,21	0,00	1
VALE3	515,95	3,64	0,00	1
RENT3	457,53	3,23	0,00	1
EQTL3	449,58	3,17	0,00	1
IGTI11	447,62	3,16	0,00	1
ITUB4	429,58	3,03	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

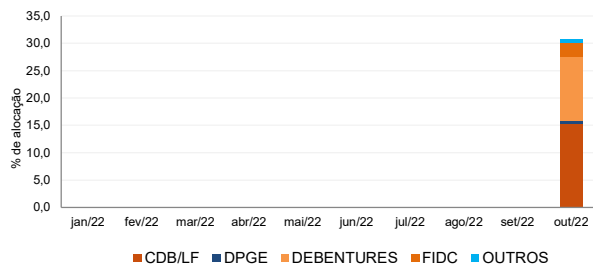
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	10.833,62	4,20	Faixa 1
BCO SAFRA SA	5.031,89	1,95	Faixa 1
BCO ITAU SA	4.309,62	1,67	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	3.114,19	1,21	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.741,55	0,68	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.728,25	0,67	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	1.721,86	0,67	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.522,93	0,59	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	1.244,22	0,48	Faixa 1
ENERGISA SA	1.196,98	0,46	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
CSNAA2	94,92	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Sem Faixa	Faixa 1	20-dez-27	CDI	2,58%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
DASAA8	110,70	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-out-27	CDI	1,64%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
GUAR16	268,84	GUARARAPES CONFECOES SA (EX CONFECOEC	Sem Faixa	Faixa 3	25-out-27	CDI	2,35%	CA INDOSEZ PENSION FI RF CRED PRIV
MRFGA0	94,78	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,77%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
MRFGA0	16,07	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	Faixa 2	Faixa 1	15-jan-26	CDI	1,47%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RDORA5	27,17	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-32	CDI	2,05%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV 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	109.555	0,04%	CDI	CENTRO IMAGEM DIAGNÓSTICOS S.A.	18-out-22	3,99%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
AALR13	04-out-27	22.038	0,01%	CDI	CENTRO IMAGEM DIAGNÓSTICOS S.A.	18-out-22	4,29%	Faixa 3	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
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
BRKPA0	15-abr-27	1.395	0,00%	CDI	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	06-out-22	2,18%	Faixa 3	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
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	358.009	0,14%	CDI	CIELO SA	03-out-22	1,23%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
CIEL16	20-set-25	17.718	0,01%	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
CPTM15	15-set-30	225.316	0,09%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CPTM15	15-set-30	112.658	0,04%	IPCA	LIGGA TELECOMUNICAÇÕES S.A.	07-out-22	8,83%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CRA REIC 7 1	30-nov-26	3.314	0,00%	CDI	REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMO	10-out-22	6,67%	Sem Faixa	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
CSNAA2	20-dez-27	94.925	0,04%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	25-out-22	2,58%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ELDC14	20-set-24	4.207	0,00%	CDI	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	20-out-22	1,87%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
ENGBI7	20-out-29	539.200	0,21%	CDI	ENERGISA SA	20-out-22	1,65%	Faixa 1	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
GUAR16	25-out-27	268.844	0,10%	CDI	GUARARAPES CONFECCOES SA (EX COI	31-out-22	2,35%	Faixa 3	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
ITPO14	15-nov-36	54.763	0,02%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	26-out-22	7,70%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LCAMA9	15-jan-26	1.270	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	05-out-22	0,82%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	13-mai-24	493	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	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	50.462	0,02%	CDI	BANCO MODAL SA	06-out-22	1,70%	Faixa 3	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
LF CDI	07-out-24	50.462	0,02%	CDI	BANCO MODAL SA	06-out-22	1,70%	Faixa 3	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
LF CDI	07-out-24	1.995	0,00%	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	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-out-22	0,96%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	13-out-26	50.403	0,02%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	11-out-22	1,20%	Faixa 2	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
LF CDI	18-nov-30	893	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	13-out-22	3,00%	Faixa 1	ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	12-abr-50	327	0,00%	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
MEAL21	15-mar-26	3.009	0,00%	CDI	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMET	27-out-22	6,19%	Faixa 4	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD25	13-set-29	18.454	0,01%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,60%	Faixa 1	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
NTSD35	13-set-32	48.674	0,02%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	06-out-22	1,98%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OCNP13	08-nov-26	4.657	0,00%	CDI	OCEANPACT SERVICOS MARITIMOS S.A.	19-out-22	3,86%	Sem Faixa	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
RORA5	15-out-32	27.166	0,01%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	19-out-22	2,05%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SSED21	15-ago-23	7.095	0,00%	CDI	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	06-out-22	1,52%	Faixa 2	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PR
UNEG11	15-jul-39	66.950	0,03%	IPCA	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	21-out-22	7,52%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
YDUQ16	18-fev-26	7.572	0,00%	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	242.215	0,09%	Selic	06-out-22	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.545	0,00%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	765	0,00%	Selic	25-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	537	0,00%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	383	0,00%	Selic	19-out-22	0,02%	0,01%	ITAU VERSO A RF REF DI FI

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV RAI

Data-base: 31/10/2022

Titulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2026-03-01	01-mar-26	0	0,00%	Selic	20-out-22	0,10%	0,00%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	0	0,00%	Selic	20-out-22	0,10%	0,00%	ITAU VERSO A RF REF DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	54.116	0,02%	Selic	27-out-22	0,10%	0,10%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2026-09-01	01-set-26	6.000	0,00%	Selic	27-out-22	0,10%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-09-01	01-set-26	8	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	0,01%	Selic	27-out-22	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	4.788	0,00%	Selic	27-out-22	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2027-03-01	01-mar-27	3	0,00%	Selic	27-out-22	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LTN 2026-01-01	01-jan-26	367.565	0,14%	PRE	10-out-22	11,60%	11,51%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-01-01	01-jan-26	66.831	0,03%	PRE	10-out-22	11,54%	11,51%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-01-01	01-jan-26	8.688	0,00%	PRE	03-out-22	11,67%	11,47%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	70.127	0,03%	IPCA	24-out-22	6,33%	6,17%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	12.490	0,00%	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 PLANO CV CARTEIRA PROPF
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	0,35%	IPCA	31-out-22	5,54%	5,38%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	250.072	0,10%	IPCA	31-out-22	5,54%	5,38%	ITAU GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	61.862	0,02%	IPCA	19-out-22	5,71%	5,63%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	4.082	0,00%	IPCA	14-out-22	5,67%	5,69%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	126.646	0,05%	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	0,15%	IPCA	04-out-22	5,63%	5,69%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	47.344	0,02%	IPCA	17-out-22	5,75%	5,69%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	20.447	0,01%	IPCA	26-out-22	5,73%	5,78%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
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	0,08%	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 PLANO CV CARTEIRA PROPF
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	3,73%	IPCA	18-out-22	5,77%	5,76%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	45.470	0,02%	IPCA	13-out-22	5,82%	5,82%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	23.123	0,01%	IPCA	19-out-22	5,75%	5,76%	ITAU UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	23.113	0,01%	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	0,03%	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