

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/11/2022

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	116.422.528,90	100%				1,08%			2,13%					
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	84.844.260,73	72,92%												
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF	84.844.260,73	72,92%		100%		1,10%	-	-	2,13%	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%		
RF CRÉDITO	20.436.603,96	17,56%												
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	6.969.768,99	5,99%	CA INDOSUEZ	6,31%		1,23%	3,67%	7,56%	13,81%	14,92%	23,95%	-		
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	3.133.900,05	2,69%	ARX	1,26%		1,11%	3,63%	-	-	-	-	-		
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	595.223,20	0,51%	AUGME	0,25%		1,00%	3,42%	7,27%	13,29%	14,48%	24,02%	29,52%		
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	8.014.843,38	6,89%	CAPITANIA CAPITAL	7,78%		1,10%	3,41%	7,03%	13,44%	14,50%	-	-		
CAPTALYS ORION FIC FI MULT CRED PRIV	812.081,80	0,70%	CAPTALYS	0,06%		-0,43%	-4,34%	-1,06%	4,09%	5,10%	13,50%	25,21%		
MILENIO 180 FIC FI MULT CRED PRIV	910.786,54	0,78%	MILENIO CAPITAL	1,16%		1,15%	3,52%	8,20%	14,63%	15,91%	28,72%	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%		
RF REFERENCIADO DI	10.755.543,08	9,24%												
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	10.755.543,08	9,24%	BRADESCO	0,12%		0,99%	3,08%	6,38%	10,84%	11,65%	15,82%	18,77%		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%		
FIDC	386.121,14	0,33%												
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	21.553,80	0,02%	BNY MELLON	1,19%		1,33%	4,11%	8,53%	14,70%	15,84%	21,55%	26,29%		
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	58.831,73	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	305.735,60	0,26%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%		
Total	116.357.633,93	100%				0,03%	1,02%	3,15%	6,55%	12,30%	13,03%	17,65%	20,82%	
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,76%	1,79%	2,57%	9,42%	10,67%	28,02%	39,50%		

* 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.

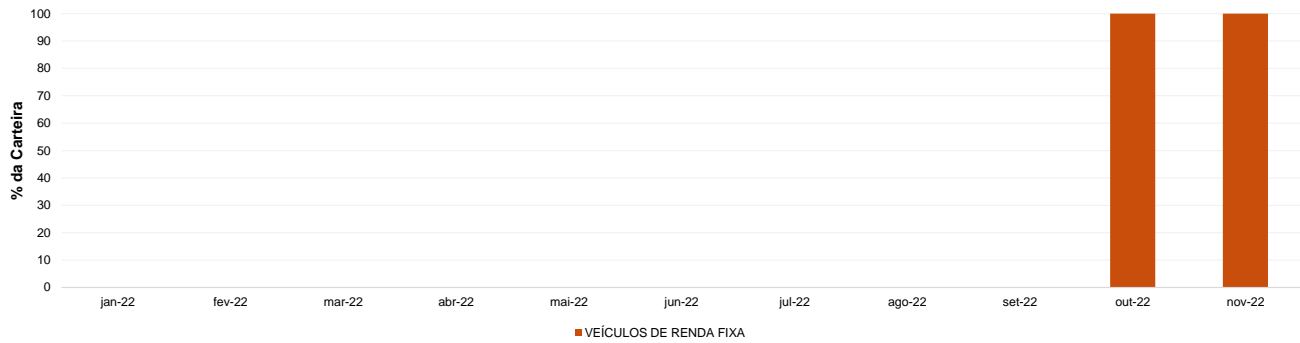
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

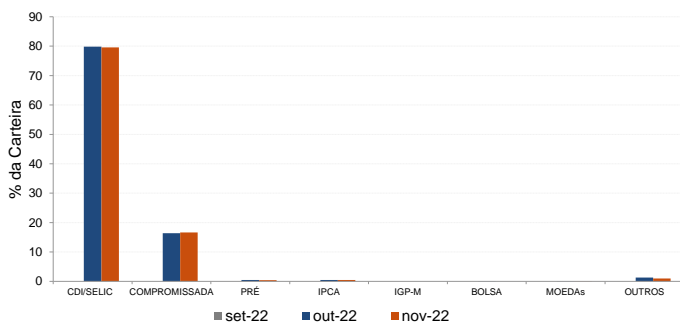
Distribuição da Carteira

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.

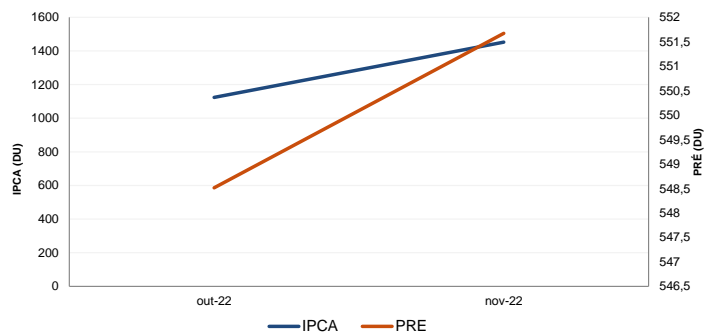
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

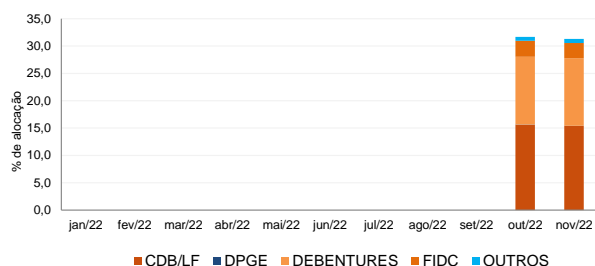
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.954,02	3,40	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.150,72	1,85	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.791,20	1,54	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.589,84	1,37	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	881,57	0,76	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	791,79	0,68	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	741,56	0,64	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	571,67	0,49	Faixa 2
BANCO CSF SA	502,05	0,43	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	500,33	0,43	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
LAMEA7	27,38	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,80%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	133,09	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,80%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/11/2022

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
BRKPA0	15-abr-27	2.023	0,00%	CDI	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	07-nov-22	2,13%	Faixa 3	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
BRKPA0	15-abr-27	1.282	0,00%	CDI	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	07-nov-22	2,13%	Faixa 3	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CDB PRE	05-abr-23	11.966	0,01%	PRE	AMERICANAS S.A	23-nov-22	16,23%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CDB PRE	05-abr-23	11.959	0,01%	PRE	AMERICANAS S.A	23-nov-22	16,23%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CRA REIC 7 1	30-nov-26	1.251	0,00%	CDI	REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMO	07-nov-22	6,67%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CRA REIC 7 1	30-nov-26	1.251	0,00%	CDI	REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMO	21-nov-22	6,71%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CRI OPEA 82 1	09-nov-29	62.751	0,05%	CDI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	10-nov-22	3,13%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	21.328	0,02%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	22-nov-22	8,17%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LF CDI	28-nov-24	50.027	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	0,95%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI	28-nov-25	50.028	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	1,15%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI	09-nov-26	201.672	0,17%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	08-nov-22	1,20%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI	30-nov-26	50.028	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	1,30%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI Mensal	03-dez-24	100.289	0,09%	CDI	BCO BMG SA	23-nov-22	1,75%	Faixa 3	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI Mensal	19-mai-25	100.385	0,09%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	16-nov-22	1,05%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
MEAL21	15-mar-26	699	0,00%	CDI	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMEN	08-nov-22	6,17%	Faixa 4	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
MULPA0	15-out-28	67.980	0,06%	CDI	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILI	23-nov-22	1,25%	Faixa 1	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
RAHD11	15-out-40	70.354	0,06%	IPCA	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	11-nov-22	8,12%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RNDNB0	09-nov-29	46.688	0,04%	CDI	RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPAC	09-nov-22	1,69%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
RODB11	10-mai-30	5.657	0,00%	CDI	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	03-nov-22	3,29%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
RODB11	10-mai-30	1.515	0,00%	CDI	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	04-nov-22	3,23%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
RODB11	10-mai-30	1.515	0,00%	CDI	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	04-nov-22	3,23%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
SSED21	15-ago-23	171	0,00%	CDI	COGNA EDUCACAO S.A.	08-nov-22	1,59%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
VCCO11	23-ago-25	10.942	0,01%	CDI	MOTTU I S.A.	01-nov-22	6,64%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VCCO11	23-ago-25	10.942	0,01%	CDI	MOTTU I S.A.	29-nov-22	7,24%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VVAR26	30-abr-26	85.830	0,07%	CDI	VIA VAREJO SA	21-nov-22	8,50%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	230.427	0,20%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	149.985	0,13%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	44.980	0,04%	Selic	11-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	24.964	0,02%	Selic	21-nov-22	0,02%	0,02%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2023-03-01	01-mar-23	23.027	0,02%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.605	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.452	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	307	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	8	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	5	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1	0,00%	Selic	11-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	0	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	0	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	0	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	0	0,00%	Selic	04-nov-22	0,02%	0,02%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	630.395	0,54%	Selic	04-nov-22	0,01%	0,00%	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
LFT 2024-09-01	01-set-24	153.475	0,13%	Selic	14-nov-22	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	5	0,00%	Selic	14-nov-22	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	3.068	0,00%	Selic	21-nov-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	0	0,00%	Selic	21-nov-22	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	76.621	0,07%	Selic	24-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	40.609	0,03%	Selic	23-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	3	0,00%	Selic	24-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	1	0,00%	Selic	23-nov-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT