

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>4.671.648,03</b>	<b>100%</b>				<b>1,06%</b>	<b>2,53%</b>		<b>2,53%</b>			
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%
<b>Multiestatégia</b>	<b>4.671.648,03</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>							
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	1.627.395,41	34,82%	ITAÚ	0,05%	0,03%	1,15%	3,49%	7,31%	12,61%	13,57%	19,35%	22,49%
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	3.044.252,62	65,14%	ITAÚ	0,01%	0,01%	1,02%	3,18%	6,56%	11,28%	12,13%	16,56%	19,79%
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%
<b>Total</b>	<b>4.673.648,03</b>	<b>100%</b>			<b>0,01%</b>	<b>1,04%</b>	<b>3,34%</b>		<b>3,34%</b>			
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%

\* 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.

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 30/11/2022

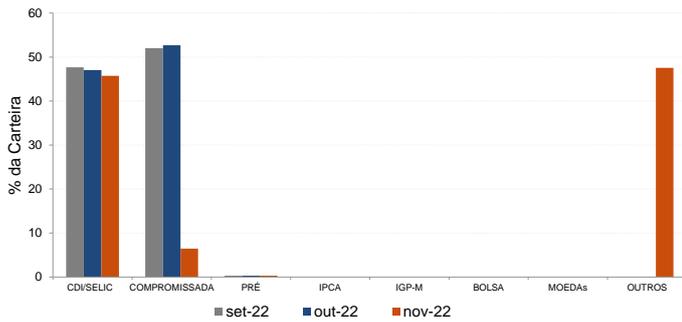
## Distribuição da Carteira

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.

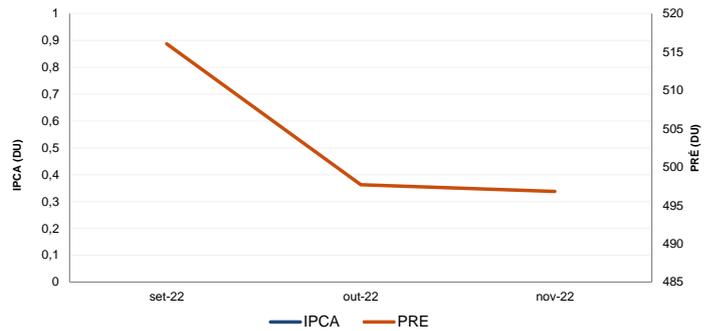
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	209,06	4,53	Faixa 1
BCO ITAU SA	107,23	2,33	Faixa 1
BCO SAFRA SA	96,38	2,09	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	59,11	1,28	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	49,84	1,08	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	48,98	1,06	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	47,34	1,03	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	29,81	0,65	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	27,98	0,61	Faixa 2
BANCO XP S.A	27,23	0,59	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.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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
LF CDI	28-nov-24	2.495	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	0,95%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	03-dez-24	883	0,02%	CDI	BCO BMG SA	23-nov-22	1,75%	Faixa 3	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-nov-25	2.716	0,06%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	1,15%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-nov-26	2.031	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	1,30%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LORTB9	25-fev-29	5.668	0,12%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	18-nov-22	1,91%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LORTB9	25-fev-29	4.256	0,09%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	18-nov-22	1,91%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
RNDNB0	09-nov-29	2.405	0,05%	CDI	RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPACI	09-nov-22	1,69%	Faixa 2	ITAÚ 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	14	0,00%	Selic		24-nov-22	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	358	0,01%	Selic		24-nov-22	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.154	0,05%	Selic		21-nov-22	0,02%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-03-01	01-mar-29	22.071	0,48%	Selic		30-nov-22	0,18%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI