

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/12/2022

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	110.641.031,22	94,79%				1,14%	3,30%		3,30%					
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	73.034.926,71	62,57%												
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF	73.034.926,71	62,57%		100%		1,16%	3,31%	-	3,31%	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
RF CRÉDITO	20.678.437,45	17,72%												
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	7.059.078,66	6,05%	CA INDOSUEZ	6,78%		1,28%	3,76%	7,69%	15,27%	15,27%	24,87%	-		
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	3.172.528,48	2,72%	ARX	1,23%		1,23%	3,58%	-	-	-	-	-		
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	602.970,19	0,52%	AUGME	0,26%		1,30%	3,57%	7,41%	14,76%	14,76%	24,77%	30,61%		
CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	8.111.885,35	6,95%	CAPITANIA CAPITAL	8,39%		1,21%	3,38%	7,24%	14,81%	14,81%	-	-		
CAPTALYS ORION FIC FI MULT CRED PRIV	806.035,31	0,69%	CAPTALYS	0,06%		-0,74%	-0,53%	-2,88%	3,31%	3,31%	11,74%	23,04%		
MILENIO 180 FIC FI MULT CRED PRIV	925.939,45	0,79%	MILENIO CAPITAL	1,16%		1,66%	4,04%	8,52%	16,53%	16,53%	29,95%	-		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
RF REFERENCIADO DI	9.869.493,77	8,46%												
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	9.869.493,77	8,46%	BRADESCO	0,12%		1,11%	3,14%	6,49%	12,07%	12,07%	16,86%	19,65%		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
RF	6.688.302,61	5,73%												
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	6.688.302,61	5,73%	ITAÚ	0,37%		1,14%	1,88%	4,39%	10,33%	10,33%	16,35%	22,32%		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
FIDC	369.870,68	0,32%												
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	21.940,53	0,02%	BNY MELLON	0,00%		1,46%	4,18%	8,68%	16,37%	16,37%	23,07%	27,51%		
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	59.605,73	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	288.324,42	0,25%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
Estruturado	6.150.437,01	5,27%				0,02%			0,02%					
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,38%	3,95%	8,21%	15,73%	15,73%	24,43%	31,69%		
MM FIC	4.100.133,09	3,51%												
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	4.100.133,09	3,51%	ITAÚ	1,10%		1,37%	1,96%	6,46%	18,84%	18,84%	-	-		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
MM MACRO	2.050.303,92	1,76%												
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO PLUS MULT FIC FI	2.050.303,92	1,76%	ITAÚ	0,06%		1,18%	2,44%	6,60%	16,04%	16,04%	20,64%	24,52%		
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%		
Total	116.721.195,23	100%				0,33%	1,13%	3,22%	6,70%	13,57%	13,57%	17,83%	21,10%	
Benchmark:	IPCA + 4,5% a.a.					1,01%	2,74%	2,53%	10,53%	10,53%	27,10%	38,79%		

* 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.

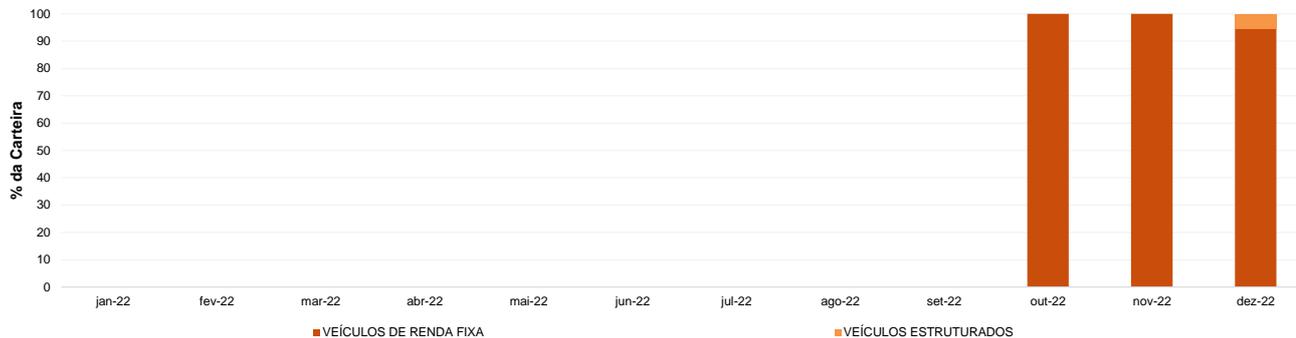
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

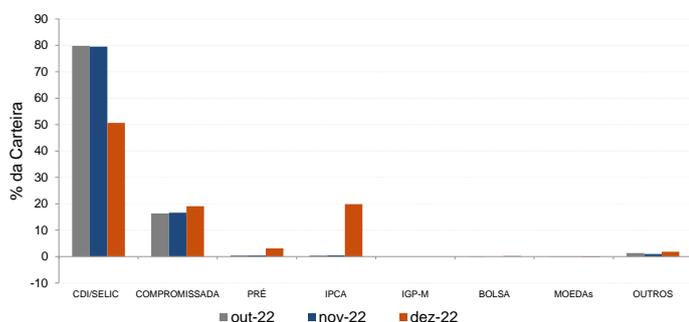
Distribuição da Carteira

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.

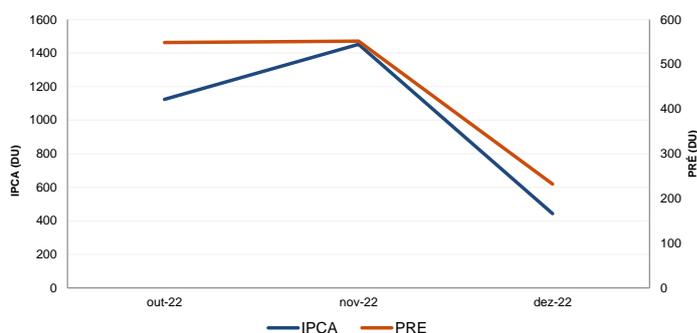
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	108,47	13,62	0,00	
ELET3	Energia Elétrica	83,68	10,51	0,00	
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	56,38	7,08	0,00	
ITSA4	Intermediários Financeiros	47,89	6,02	0,00	
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	46,27	5,81	0,00	
EQTL3	Energia Elétrica	39,83	5,00	0,00	
SBSP3	Água e Saneamento	36,98	4,64	0,00	
RENT3	Diversos	32,82	4,12	0,00	
LREN3	Comércio	30,41	3,82	0,00	
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	29,76	3,74	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

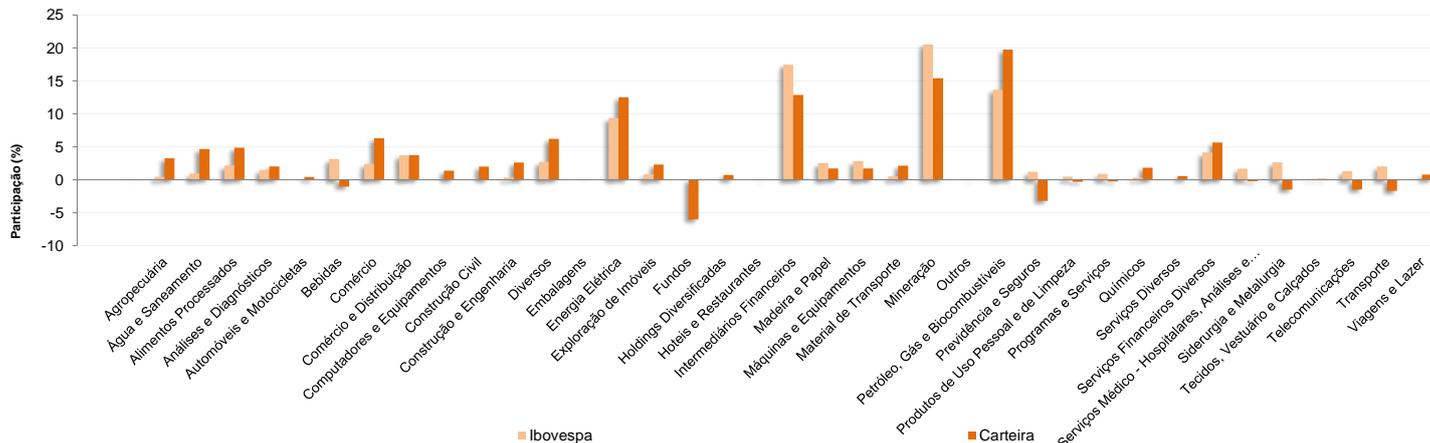
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MODL11	1,56	0,20	0,00	Sem Liquidez
BKBR3	0,68	0,09	0,00	Sem Liquidez
VALE3	108,47	13,62	0,00	1
ELET3	83,68	10,51	0,00	1
PETR4	56,38	7,08	0,00	1
ITSA4	47,89	6,02	0,00	1
PRI03	46,27	5,81	0,00	1
EQTL3	39,83	5,00	0,00	1
SBSP3	36,98	4,64	0,00	1
RENT3	32,82	4,12	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.



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.

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	4.040,58	3,47	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.418,60	2,08	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.779,94	1,53	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.490,08	1,28	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.052,29	0,90	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	856,78	0,74	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	616,18	0,53	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	569,28	0,49	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	540,52	0,46	Faixa 1
BANCO CSF SA	502,28	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
HYPEA4	151,85	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,43%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP
HYPEA4	12,53	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,52%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
IRBR11	69,44	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	Faixa 1	Faixa 2	15-out-23	CDI	65,35%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
MVLVA1	36,81	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	22-dez-27	CDI	3,00%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
MVLVA1	22,50	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	22-dez-27	CDI	3,00%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
NCE CDI Semestral	2,30	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBR	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-24	CDI	1,35%	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
NCE CDI Semestral	65,40	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBR	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-24	CDI	1,03%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/12/2022

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
AALM11	13-jul-26	8.048	0,01%	CDI	AURA ALMAS MINERAÇÃO S.A.	08-dez-22	3,37%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
ANEM11	15-jun-39	42.989	0,04%	IPCA	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	01-dez-22	8,61%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	31.978	0,03%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,70%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
BRKMB8	09-nov-32	16.958	0,01%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,95%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
CNRD11	15-dez-35	10.097	0,01%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CNRD11	15-dez-35	4.172	0,00%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CNRD11	15-dez-35	4.089	0,00%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ENAT11	15-dez-27	73.141	0,06%	IPCA	ENAUTA PARTICIPACOES S.A	23-dez-22	4,41%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
HYPEA4	14-dez-27	151.848	0,13%	CDI	HYPERA S.A.	23-dez-22	1,43%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
JHSFA3	20-dez-27	145.643	0,13%	CDI	JHSF PARTICIPACOES SA	22-dez-22	2,20%	Sem Faixa	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
LF CDI	29-jan-26	49.979	0,04%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	28-dez-22	1,20%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI	17-dez-29	301.941	0,26%	CDI	BCO SAFRA SA	15-dez-22	2,00%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI Mensal	02-dez-24	50.550	0,04%	CDI	BANCO XP S.A	02-dez-22	1,00%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI Mensal	10-out-25	251.943	0,22%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	09-dez-22	1,15%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF CDI Mensal	01-dez-25	101.168	0,09%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-22	1,15%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LF PRE	02-jan-26	159.898	0,14%	PRE	BCO VOLKSWAGEN SA	13-dez-22	14,73%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
MVLVA1	22-dez-27	36.808	0,03%	CDI	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	28-dez-22	3,00%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
NCE CDI Semestral	20-jun-24	2.303	0,00%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EI	26-dez-22	1,35%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
PEJA11	15-ago-32	93.811	0,08%	IPCA	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	07-dez-22	8,00%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
QUAT13	15-jul-34	73.799	0,06%	IPCA	ACUCAREIRA QUATA S.A.	27-dez-22	26,69%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SEQL13	20-nov-27	81.543	0,07%	CDI	SEQUOIA LOGÍSTICA E TRANSPORTES S.	07-dez-22	25,15%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
USIM19	09-dez-27	180.343	0,15%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	12-dez-22	1,45%	Faixa 1	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
USIM39	09-dez-32	61.000	0,05%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	12-dez-22	1,99%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VCCO11	23-ago-25	11.775	0,01%	CDI	MOTTU I S.A.	15-dez-22	48,02%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
WWAV13	15-jan-38	105.318	0,09%	IPCA	2W ENERGIA S.A.	02-dez-22	10,91%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
WWAV23	15-jan-38	4.388	0,00%	IPCA	2W ENERGIA S.A.	02-dez-22	10,91%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-03-01	01-mar-24	302.933	0,26%	Selic		27-dez-22	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2024-03-01	01-mar-24	88.356	0,08%	Selic		02-dez-22	0,02%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2025-09-01	01-set-25	45.812	0,04%	Selic		01-dez-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	0	0,00%	Selic		01-dez-22	7,00%	0,07%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	151.699	0,13%	Selic		28-dez-22	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	89.502	0,08%	Selic		07-dez-22	0,16%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	1	0,00%	Selic		28-dez-22	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	1	0,00%	Selic		07-dez-22	0,16%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	182.519	0,16%	IPCA		29-dez-22	6,53%	6,54%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	3.754.154	3,23%	IPCA		29-dez-22	6,19%	6,18%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	2.230.102	1,92%	IPCA		29-dez-22	6,21%	6,20%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	924.741	0,79%	IPCA		29-dez-22	6,21%	6,18%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (