

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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	95.578.025,66	74,47%				0,73%	1,28%		1,28%				
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	57.604.469,29	44,88%											
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	57.604.469,29	44,88%		100%		0,70%	-	-	-1,32%	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
RF CRÉDITO	20.828.543,71	16,23%											
CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PRIV	7.568.103,82	5,90%	CA INDOSUEZ	7,27%		1,28%	3,76%	7,69%	15,27%	15,27%	24,87%	-	-
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	8.920.937,19	6,95%	ARX	3,47%		1,23%	3,58%	-	-	-	-	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	900.426,26	0,70%	AUGME	0,38%		1,30%	3,57%	7,41%	14,76%	14,76%	24,77%	30,61%	-
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2.150.278,42	1,68%	CAPITANIA CAPITAL	2,22%		1,21%	3,38%	7,24%	14,81%	14,81%	-	-	-
CAPTALYS ORION FIC FI MULT CRED PRIV	606.339,86	0,47%	CAPTALYS	0,04%		-0,74%	-0,53%	-2,88%	3,31%	3,31%	11,74%	23,04%	-
MILENIO 180 FIC FI MULT CRED PRIV	682.458,16	0,53%	MILENIO CAPITAL	0,85%		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	12.204.594,96	9,51%											
GERI TENAX FI RF LP	2.555.574,20	1,99%	TENAX CAPITAL	5,90%		0,80%	1,36%	3,90%	8,54%	8,54%	6,44%	12,26%	-
PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP	4.874.443,53	3,80%	PACIFICO	3,64%		0,16%	0,57%	2,88%	6,22%	6,22%	-	-	-
ITAU GERI RF FI	4.774.577,24	3,72%	ITAU	10,92%		0,27%	0,77%	3,49%	8,28%	8,28%	-5,35%	1,91%	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
RF	4.451.033,09	3,47%											
ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.451.033,09	3,47%	ITAU	0,24%		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	489.384,60	0,38%											
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	66.239,43	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	404.455,09	0,32%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.690,08	0,01%	BNY MELLON	0,00%		1,46%	4,18%	8,68%	16,37%	16,37%	23,07%	27,51%	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
Renda Variável	7.167.775,23	5,58%				3,16%	1,30%		1,30%				
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-2,19%	0,45%	13,03%	7,81%	7,81%	-2,21%	3,65%	
RV VALOR	2.850.431,39	2,22%											
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	446.331,87	0,35%	ABSOLUTO PARTNERS	0,11%		-4,62%	-9,44%	2,44%	-11,78%	-11,78%	-35,95%	-14,96%	-
BOGARI VALUE T INSTIT. FIC FIA	1.066.893,20	0,83%	BOGARI	3,75%		-4,66%	-11,62%	-1,20%	-24,53%	-24,53%	-	-	-
KIRON INSTIT. FIA	428.903,11	0,33%	KIRON CAPITAL	0,90%		-3,93%	-4,38%	12,22%	6,37%	6,37%	-14,02%	-15,96%	-
LIS VALUE FIA	364.394,28	0,28%	LIS CAPITAL	0,16%		-3,59%	-7,99%	3,06%	-13,79%	-13,79%	-16,59%	0,05%	-
MCTAG FIC FIA	543.908,93	0,42%	MOAT CAPITAL	1,85%		-5,69%	-16,40%	-1,82%	-14,97%	-14,97%	-31,76%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
RV PASSIVO	2.547.885,40	1,99%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	2.547.885,40	1,99%	BLACKROCK	0,02%		-1,25%	2,07%	10,36%	5,11%	5,69%	-7,85%	-5,63%	-
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
RV LONG BIAS	772.236,95	0,60%											
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	772.236,95	0,60%	SHARP	1,50%		-2,17%	0,93%	13,88%	11,68%	11,68%	2,97%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
RV SMALL CAP	643.234,16	0,50%											
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	548.837,60	0,43%	AZ QUEST	0,05%		-1,80%	-3,58%	3,72%	-8,69%	-8,69%	-17,52%	-20,12%	-
ISHARES BMF BOVESPA SMALL CAP FDO INDICE	94.396,55	0,07%	BLACKROCK	0,00%		-2,31%	-5,83%	4,35%	-14,81%	-13,24%	-28,50%	-29,56%	-
Benchmark:	SMML					-3,01%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-15,06%	-28,82%	-29,28%	
RV ATIVO	353.987,34	0,28%											
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	353.987,34	0,28%	AZ QUEST	0,12%		-3,81%	-3,23%	7,61%	-0,35%	-0,35%	-16,78%	-20,00%	-
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
Estruturado	19.978.219,27	15,57%				0,33%	0,21%		0,21%				
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,38%	3,95%	8,21%	15,73%	15,73%	24,43%	31,69%	

* 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 PERFIL MODERADO 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	
MM MACRO	13.573.227,98	10,58%											
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIMEN	4.451.688,46	3,47%	ITAÚ	3,19%		1,23%	3,32%	8,01%	19,65%	19,65%	-	-	
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.617.633,12	2,04%	ITAÚ	1,36%		0,75%	-1,00%	5,61%	19,64%	19,64%	20,82%	-	
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	318.046,75	0,25%	IBIUNA	0,01%		-0,39%	0,98%	5,10%	19,48%	19,48%	31,70%	52,15%	
SOLANA EQ.HEDG. VIII FIC FI MULT	821.815,57	0,64%	SOLANA	1,25%		1,67%	-1,27%	12,89%	12,59%	-	-	-	
CLAVE ALPHA MACRO II FIC FI MULT	97.771,83	0,08%	CLAVE	0,03%		3,23%	6,94%	9,75%	-	-	-	-	
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1.166.542,91	0,91%	SPX	2,12%		0,09%	-5,86%	-0,12%	21,43%	21,43%	33,53%	43,58%	
GENOA TL FIC FI MULT	763.003,08	0,59%	GENOA	0,86%		1,05%	3,25%	9,01%	21,32%	21,32%	31,90%	-	
KAPITALO ZETA FIC FI MULT	583.832,29	0,45%	KAPITALO	0,02%		0,51%	4,63%	9,43%	19,67%	19,67%	30,57%	31,28%	
NW3 EVENT DRIVEN PLUS FIC FI MULT	418.480,22	0,33%	NW3	0,13%		1,55%	2,18%	8,43%	15,42%	15,42%	22,89%	16,58%	
RPS TOTAL RETURN FIC FI MULT D30 TAG	569.283,93	0,44%	RPS CAPITAL	1,63%		2,94%	-3,03%	1,59%	5,71%	5,71%	9,39%	14,49%	
CLAVE ALPHA MACRO FIC FI MULT	687.638,41	0,54%	CLAVE	0,24%		3,22%	6,92%	9,73%	19,43%	19,43%	31,24%	-	
VISTA HEDGE D30 FIC FI MULT	525.013,70	0,41%	VISTA	0,11%		-0,20%	-3,58%	-4,47%	-	-	-	-	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	552.477,70	0,43%	ZEITGEIST	0,03%		-0,66%	-1,45%	0,61%	9,09%	9,09%	17,56%	28,29%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
MM FIC	6.404.991,29	4,99%											
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	2.395.494,17	1,87%	ITAÚ	0,64%		1,37%	1,96%	6,46%	18,84%	18,84%	-	-	
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4.009.497,12	3,12%	ITAÚ	1,21%		-2,66%	-2,48%	5,50%	7,45%	7,45%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
Exterior	5.555.217,11	4,33%				1,15%	2,33%	2,33%					
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					-5,72%	5,60%	1,82%	-24,70%	-24,70%	-2,86%	42,85%	
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.555.217,11	4,33%											
CARTEIRA ITAU INTERNACIONAL INSTIT. FICFI MULT	566.481,81	0,44%	ITAÚ	1,02%		-0,83%	4,55%	1,64%	-19,10%	-19,10%	-	-	
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.988.735,30	3,89%	TAG INVEST	9,27%		1,38%	2,08%	3,06%	-16,96%	-16,96%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
Total	128.350.804,54	100%				1,02%	0,33%	1,24%	5,13%	9,67%	9,67%	11,25%	13,76%
Benchmark:	IPCA + 5,5% a.a.					1,09%	2,98%	3,03%	11,58%	11,58%	29,53%	42,80%	

* 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.

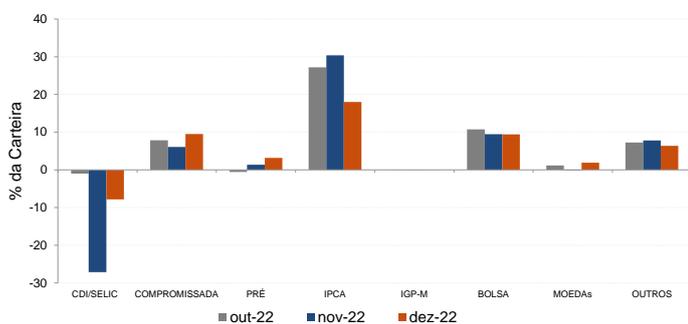
Distribuição da Carteira

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.

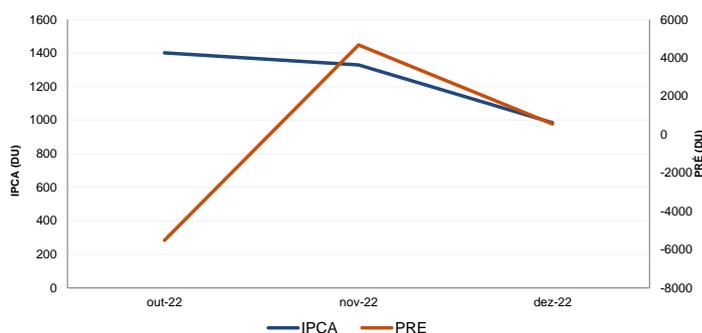
Evolução do Patrimônio Líquido



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	691,19	5,18	729,67	5,56
ENG111	Energia Elétrica	466,33	3,49	475,15	3,62
ELET3	Energia Elétrica	436,08	3,27	540,35	4,12
EQTL3	Energia Elétrica	435,92	3,26	384,23	2,93
IGT111	Exploração de Imóveis	431,41	3,23	407,61	3,11
SBSP3	Água e Saneamento	382,60	2,86	425,78	3,24
SHV US		362,03	2,71	367,33	2,80
CPFE3	Energia Elétrica	359,15	2,69	371,24	2,83
RENT3	Diversos	348,20	2,61	343,79	2,62
AURE3	Energia Elétrica	339,67	2,54	329,59	2,51

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

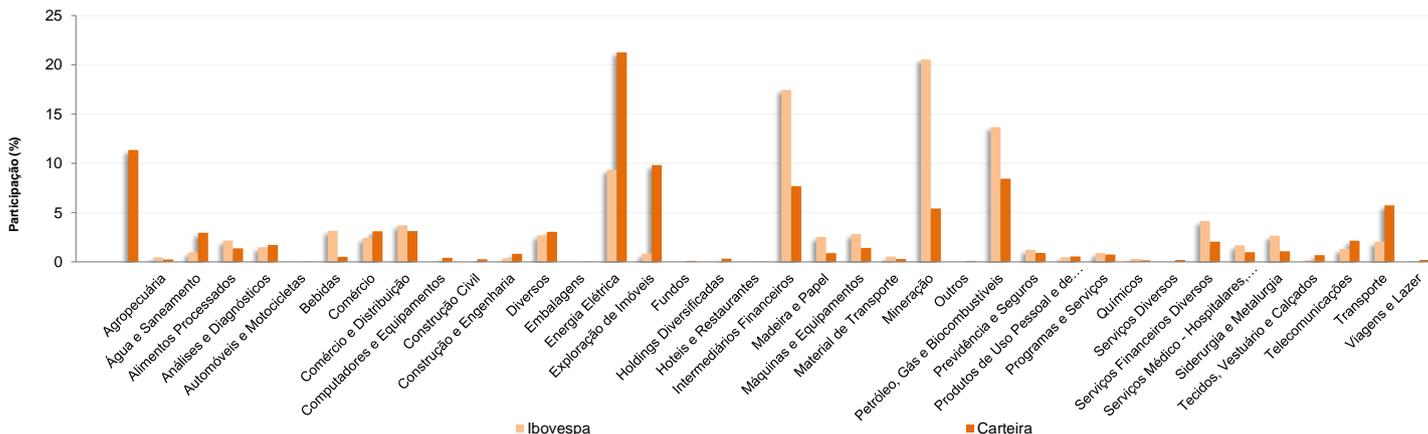
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	26,75	0,20	0,33	168
VALE3	691,19	5,18	0,00	1
ENG111	466,33	3,49	0,01	1
ELET3	436,08	3,27	0,00	1
EQTL3	435,92	3,26	0,00	1
IGT111	431,41	3,23	0,00	1
SBSP3	382,60	2,86	0,00	1
CPFE3	359,15	2,69	0,01	1
RENT3	348,20	2,61	0,00	1
AURE3	339,67	2,54	0,01	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	6.399,81	5,03	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.672,48	2,10	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.521,82	1,20	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.499,70	1,18	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.164,99	0,92	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.152,54	0,91	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.026,89	0,81	Faixa 1
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	925,95	0,73	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	855,13	0,67	Faixa 1
ENERGISA SA	834,43	0,66	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
HYPEA4	162,39	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,43%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF
HYPEA4	35,23	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,52%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
IRBR11	18,41	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	Faixa 1	Faixa 2	15-out-23	CDI	65,35%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
MVLVA1	37,29	MOVIDA LOCAÇÃO VEICULOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	22-dez-27	CDI	2,90%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF
MVLVA1	63,27	MOVIDA LOCAÇÃO VEICULOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	22-dez-27	CDI	3,00%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
MVLVA1	9,76	MOVIDA LOCAÇÃO VEICULOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	22-dez-27	CDI	3,00%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
NCE CDI Semestral	3,44	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBR	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-24	CDI	1,35%	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
NCE CDI Semestral	183,91	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 MODERADO 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	12.018	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	11.395	0,01%	IPCA	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	01-dez-22	8,61%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	31.978	0,03%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,70%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
BRKMB8	09-nov-32	16.958	0,01%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,95%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
CNRD11	15-dez-35	2.676	0,00%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CNRD11	15-dez-35	1.106	0,00%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CNRD11	15-dez-35	1.084	0,00%	IPCA	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 :	14-dez-22	23,93%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ENAT11	15-dez-27	19.388	0,02%	IPCA	ENAUTA PARTICIPACOES S.A	23-dez-22	4,41%	Sem Faixa	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
HYPEA4	14-dez-27	162.393	0,13%	CDI	HYPERA S.A.	23-dez-22	1,43%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
JHSFA3	20-dez-27	156.146	0,12%	CDI	JHSF PARTICIPACOES SA	22-dez-22	2,20%	Sem Faixa	CA INDOSUEZ PENSION FI RF CRED PR
LF CDI	13-dez-27	302.596	0,24%	CDI	PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMEN	12-dez-22	2,75%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	16-dez-27	301.823	0,24%	CDI	BANCO XP S.A	16-dez-22	2,50%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	28-jan-28	99.863	0,08%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	28-dez-22	1,50%	Faixa 2	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF PRE	02-jan-26	159.898	0,13%	PRE	BCO VOLKSWAGEN SA	13-dez-22	14,73%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
MVLVA1	22-dez-27	37.294	0,03%	CDI	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	28-dez-22	2,90%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
MVLVA1	22-dez-27	9.757	0,01%	CDI	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	28-dez-22	3,00%	Faixa 1	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
NCE CDI Semestral	20-jun-24	3.439	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	24.867	0,02%	IPCA	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	07-dez-22	8,00%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
QUAT13	15-jul-34	19.562	0,02%	IPCA	ACUCAREIRA QUATA S.A.	27-dez-22	26,69%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SEQL13	20-nov-27	21.615	0,02%	CDI	SEQUIA LOGÍSTICA E TRANSPORTES S.	07-dez-22	25,15%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
USIM19	09-dez-27	193.348	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	16.170	0,01%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	12-dez-22	1,99%	Faixa 1	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VCCO11	23-ago-25	3.121	0,00%	CDI	MOTTU I S.A.	15-dez-22	48,02%	Sem Faixa	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
WWAV13	15-jan-38	27.917	0,02%	IPCA	2W ENERGIA S.A.	02-dez-22	10,91%	Sem Faixa	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
WWAV23	15-jan-38	1.163	0,00%	IPCA	2W ENERGIA S.A.	02-dez-22	10,91%	Sem Faixa	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	63.112	0,05%	Selic	14-dez-22	0,01%	0,01%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2023-09-01	01-set-23	63.112	0,05%	Selic	29-dez-22	0,00%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3.925.510	3,09%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-09-01	01-set-24	9.226.262	7,26%	Selic	21-dez-22	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	100.927	0,08%	Selic	27-dez-22	0,03%	0,03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	75.742	0,06%	Selic	30-dez-22	0,02%	0,02%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	106.718	0,08%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	91.668	0,07%	Selic	12-dez-22	0,16%	0,16%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2.736	0,00%	Selic	06-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	5.436.497	4,28%	IPCA	21-dez-22	6,45%	6,45%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	459.019	0,36%	IPCA	21-dez-22	6,43%	6,43%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	231.541	0,18%	IPCA	21-dez-22	6,42%	6,43%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	1.750	0,00%	IPCA	16-dez-22	6,40%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	875	0,00%	IPCA	16-dez-22	6,41%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	36.503	0,03%	IPCA	14-dez-22	6,30%	6,42%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F