

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	4.719.875,19	100%				1,12%	3,29%		3,68%			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Multiestatégia	4.719.875,19	100%			0,02%							
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	1.647.267,08	34,89%	ITAÚ	0,05%	0,02%	1,22%	3,53%	7,39%	13,98%	13,98%	20,47%	23,52%
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	3.072.608,11	65,09%	ITAÚ	0,01%	0,03%	1,12%	3,21%	6,65%	12,52%	12,52%	17,58%	20,67%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Total	4.720.727,20	100%			0,02%	1,12%	3,25%		4,51%			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%

* 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.

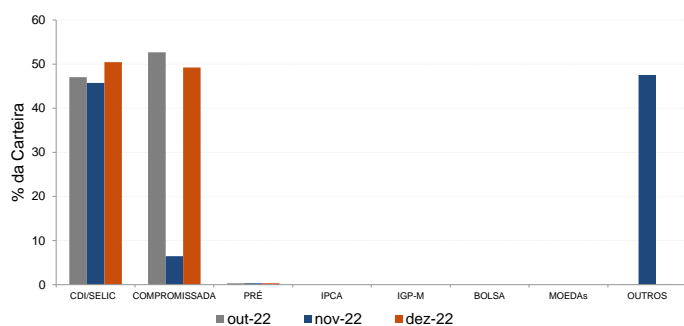
Distribuição da Carteira

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.

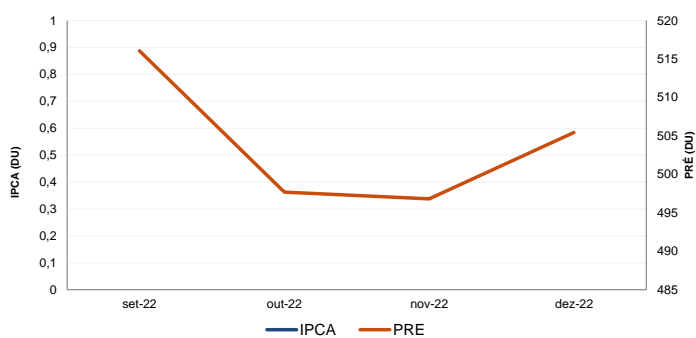
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

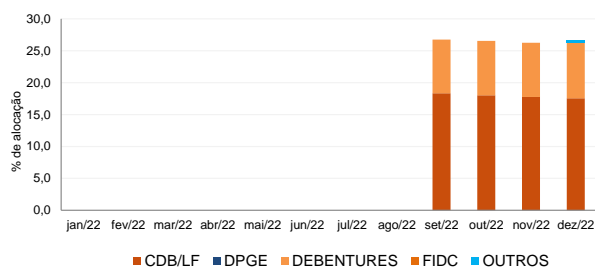
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	209,37	4,49	Faixa 1
BCO ITAU SA	109,44	2,35	Faixa 1
BCO SAFRA SA	102,40	2,20	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	59,19	1,27	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	49,89	1,07	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	49,03	1,05	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	33,53	0,72	Faixa 1
BANCO XP S.A	33,11	0,71	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	29,30	0,63	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	27,70	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
HYPEA4	11,85	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,43%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
NC CDI	15,62	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBR	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-24	CDI	1,35%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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
AMBP14	25-ago-28	2.396	0,05%	CDI	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDI	05-dez-22	2,96%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
BRKMA8	09-nov-29	1.961	0,04%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,70%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
BRKMB8	09-nov-32	1.152	0,02%	CDI	BRASKEM SA	12-dez-22	1,95%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
HYPEA4	14-dez-27	11.853	0,25%	CDI	HYPERA S.A.	23-dez-22	1,43%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	24-jan-24	817	0,02%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	12-dez-22	0,82%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	16-abr-24	691	0,01%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	14-dez-22	1,20%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-dez-24	734	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-22	1,00%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-ago-25	1.403	0,03%	CDI	BCO SAFRA SA	14-dez-22	2,62%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	10-out-25	12.336	0,26%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	09-dez-22	1,15%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-dez-25	2.348	0,05%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-22	1,15%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	29-jan-26	3.461	0,07%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	28-dez-22	1,20%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-jul-26	1.882	0,04%	CDI	BCO ITAU SA	22-dez-22	0,79%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	17-dez-29	4.380	0,09%	CDI	BCO SAFRA SA	15-dez-22	2,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	17-dez-29	146	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	15-dez-22	2,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-set-31	227	0,00%	CDI	BCO ITAU SA	14-dez-22	1,82%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	16-dez-32	2.773	0,06%	CDI	BANCO XP S.A	16-dez-22	2,50%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE	01-jan-25	3.830	0,08%	PRE	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICE	22-dez-22	14,82%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE	02-jan-26	10.954	0,24%	PRE	BCO VOLKSWAGEN SA	13-dez-22	14,73%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LORTA8	05-out-26	2.203	0,05%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	23-dez-22	1,15%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
NC CDI	20-jun-24	15.622	0,34%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EI	26-dez-22	1,35%	Faixa 1	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	19.453	0,42%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	17.727	0,38%	Selic	19-dez-22	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	17.712	0,38%	Selic	21-dez-22	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.633	0,06%	Selic	26-dez-22	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	877	0,02%	Selic	28-dez-22	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	353	0,01%	Selic	06-dez-22	0,02%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	350	0,01%	Selic	28-dez-22	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	264	0,01%	Selic	06-dez-22	0,02%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	17	0,00%	Selic	28-dez-22	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	44	0,00%	Selic	06-dez-22	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	44	0,00%	Selic	06-dez-22	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	5.488	0,12%	Selic	08-dez-22	0,16%	0,16%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	2.387	0,05%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	1.291	0,03%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	1.125	0,02%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	452	0,01%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	117	0,00%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	23	0,00%	Selic	01-dez-22	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI