

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 31/01/2023

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	82.595.526,45	70,64%				0,75%	0,89%		0,75%					
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	48.423.729,86	41,42%												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	48.423.729,86	41,42%		100%	0,36%	0,96%	-1,51%	-	0,96%	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
RF CRÉDITO	20.891.851,02	17,87%												
PENSION FI RF CRED PRIV	7.651.091,59	6,54%	CA INDOSUEZ	9,23%	0,02%	1,10%	3,65%	7,61%	1,10%	15,37%	26,04%	-	-	-
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	8.940.480,15	7,65%	ARX	3,33%	0,03%	0,22%	2,58%	-	0,22%	-	-	-	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	878.111,10	0,75%	AUGME	0,38%	0,15%	-2,48%	-0,22%	3,54%	-2,48%	10,82%	21,14%	26,41%	-	-
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2.129.333,85	1,82%	CAPITANIA CAPITAL	2,69%	0,14%	-0,97%	1,33%	5,02%	-0,97%	12,34%	-	-	-	-
CAPTALYS ORION FIC FI MULT CRED PRIV	600.994,78	0,51%	CAPTALYS	0,05%	0,01%	-4,19%	-5,31%	-7,98%	-4,19%	-1,85%	6,33%	16,67%	-	-
MILENIO 180 FIC FI MULT CRED PRIV	691.839,55	0,59%	MILENIO CAPITAL	0,84%	0,08%	1,37%	4,24%	8,69%	1,37%	16,85%	30,78%	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
RF REFERENCIADO DI	8.512.496,69	7,28%												
GERI TENAX FI RF LP	2.826.139,03	2,42%	TENAX CAPITAL	6,79%	2,25%	0,79%	1,11%	4,74%	0,79%	9,90%	8,24%	12,63%	-	-
PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP	2.842.208,71	2,43%	PACIFICO	2,20%	1,46%	0,23%	-0,17%	3,44%	0,23%	6,98%	-	-	-	-
ITAU GERI RF FI	2.844.148,95	2,43%	ITAU	7,05%	1,34%	0,52%	0,20%	4,10%	0,52%	9,18%	-3,27%	1,61%	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
RF	4.271.403,97	3,65%												
ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.271.403,97	3,65%	ITAU	0,23%	0,08%	1,11%	1,88%	4,79%	1,11%	11,31%	17,52%	23,17%	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
FIDC	496.044,91	0,42%												
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	67.220,54	0,06%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	410.164,23	0,35%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.660,14	0,02%	BNY MELLON	0,00%		1,46%	4,31%	8,81%	1,46%	16,96%	24,62%	28,75%	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%		
Renda Variável	7.162.963,17	6,13%				2,71%	-1,70%		2,71%					
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					3,64%	-1,51%	11,61%	3,64%	4,18%	4,58%	8,92%		
RV VALOR	3.367.365,94	2,88%												
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	939.039,80	0,80%	ABSOLUTO PARTNERS	0,23%	10,81%	4,05%	-12,99%	-0,19%	4,05%	-13,53%	-33,23%	-17,81%	-	-
BOGARI VALUE T INSTIT. FIC FIA	1.089.486,48	0,93%	BOGARI	3,75%	10,47%	2,12%	-15,44%	-5,34%	2,12%	-25,83%	-	-	-	-
KIRON INSTIT. FIA	438.891,31	0,38%	KIRON CAPITAL	0,87%	9,02%	2,33%	-11,67%	6,20%	2,33%	-1,04%	-11,11%	-15,22%	-	-
LIS VALUE FIA	365.495,55	0,31%	LIS CAPITAL	0,17%	8,80%	0,30%	-10,61%	0,73%	0,30%	-13,38%	-15,21%	-4,27%	-	-
MCTAG FIC FIA	534.452,80	0,46%	MOAT CAPITAL	2,26%	13,36%	-1,74%	-20,50%	-11,61%	-1,74%	-22,11%	-28,47%	-	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%		
RV PASSIVO	1.559.068,82	1,33%												
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.559.068,82	1,33%	BLACKROCK	0,01%	8,31%	3,67%	-2,06%	10,61%	3,67%	1,72%	-0,65%	0,24%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%		
RV ATIVO	973.426,92	0,83%												
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	303.936,67	0,26%	OCEANA	0,08%	8,26%	3,60%	-3,46%	9,76%	3,60%	4,66%	8,42%	8,09%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	367.242,50	0,31%	AZ QUEST	0,12%	8,68%	3,74%	-5,38%	6,78%	3,74%	-4,03%	-11,33%	-20,06%	-	-
XP INVESTOR FIA	302.247,74	0,26%	XP	0,15%	8,03%	3,46%	-8,09%	4,04%	3,46%	8,64%	3,22%	-8,73%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%		
RV LONG BIAS	681.727,37	0,58%												
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	681.727,37	0,58%	SHARP	1,39%	3,33%	3,33%	-1,33%	10,22%	3,33%	11,76%	5,23%	-	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%		
RV SMALL CAP	563.392,99	0,48%												
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	563.392,99	0,48%	AZ QUEST	0,06%	5,62%	2,65%	-9,11%	2,60%	2,65%	-8,68%	-13,68%	-23,13%	-	-
Benchmark:	SMLL					2,92%	-11,39%	3,51%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%		
CARTEIRA PRÓPRIA RV	17.981,14	0,02%												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	17.981,14	0,02%		100%	1167,30%	3,67%	5,74%	-	3,67%	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX					3,51%	-2,34%	9,39%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%		
Estruturado	20.789.650,24	17,78%				1,53%	-0,71%		1,53%					
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,38%	4,08%	8,32%	1,38%	16,19%	25,67%	32,67%		

* 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 MODERADO RAI

Data-base: 31/01/2023

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	
MM MACRO	13.755.012,23	11,76%											
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIMEN	4.515.004,91	3,86%	ITAÚ	3,22%	1,42%	1,26%	2,46%	7,96%	1,26%	20,11%	-	-	
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.663.046,57	2,28%	ITAÚ	1,25%	3,23%	1,57%	1,23%	5,85%	1,57%	19,01%	23,49%	-	
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	322.530,57	0,28%	IBIUNA	0,01%	1,42%	1,41%	0,42%	8,82%	1,41%	19,65%	34,69%	54,01%	
SOLANA EQ.HEDG. VIII FIC FI MULT	822.887,36	0,70%	SOLANA	1,15%	1,96%	0,13%	-3,69%	11,44%	0,13%	13,98%	-	-	
CLAVE ALPHA MACRO II FIC FI MULT	99.241,52	0,08%	CLAVE	0,03%	2,40%	1,50%	4,59%	11,19%	1,50%	21,52%	-	-	
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1.187.957,01	1,02%	SPX	1,84%	2,66%	1,84%	-3,28%	2,93%	1,84%	20,84%	36,91%	46,01%	
GENOA TL FIC FI MULT	763.046,28	0,65%	GENOA	0,86%	3,07%	0,01%	1,14%	7,74%	0,01%	20,16%	34,27%	-	
KAPITALO ZETA FIC FI MULT	598.224,54	0,51%	KAPITALO	0,02%	5,55%	2,47%	5,00%	8,62%	2,47%	18,16%	36,58%	37,38%	
NW3 EVENT DRIVEN PLUS FIC FI MULT	420.438,48	0,36%	NW3	0,13%	2,33%	0,47%	0,46%	6,11%	0,47%	12,40%	24,14%	16,63%	
RPS TOTAL RETURN FIC FI MULT D30 TAG	574.482,89	0,49%	RPS CAPITAL	1,60%	7,29%	0,91%	1,50%	0,21%	0,91%	7,81%	8,88%	14,24%	
CLAVE ALPHA MACRO FIC FI MULT	697.978,14	0,60%	CLAVE	0,24%	2,40%	1,50%	4,59%	11,18%	1,50%	21,61%	31,83%	-	
VISTA HEDGE D30 FIC FI MULT	533.673,20	0,46%	VISTA	0,11%	1,79%	1,65%	-2,67%	-6,80%	1,65%	-	-	-	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	556.500,74	0,48%	ZEITGEIST	0,03%	1,61%	0,73%	-0,69%	2,15%	0,73%	9,49%	22,08%	26,75%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
MM FIC	7.034.638,00	6,02%											
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	2.826.561,75	2,42%	ITAÚ	0,66%	2,64%	1,08%	1,49%	6,55%	1,08%	18,55%	-	-	
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4.208.076,26	3,60%	ITAÚ	1,13%	8,17%	2,77%	-7,29%	3,14%	2,77%	5,12%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Exterior	6.432.392,05	5,50%				-1,01%	4,23%		-1,01%				
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					4,58%	6,03%	-0,33%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.497.346,33	4,70%											
CARTEIRA ITAU INTERNACIONAL INSTIT. FICFI MULT	573.629,41	0,49%	ITAÚ	1,00%	4,43%	1,10%	7,21%	-1,49%	1,10%	-11,50%	-10,40%	-	
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.923.716,92	4,21%	TAG INVEST	9,27%	3,53%	-1,30%	3,83%	0,73%	-1,30%	-8,96%	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
RF INVESTIMENTO NO EXTERIOR	935.045,72	0,80%											
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	935.045,72	0,80%	ITAÚ	2,07%	4,22%	-1,97%	0,73%	-7,84%	-1,97%	-12,69%	-13,24%	20,42%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Total	116.922.698,94	100%				1,18%	1,15%	0,92%	5,16%	1,15%	10,21%	12,76%	14,43%
Benchmark:	IPCA + 8.1% a.a.					1,22%	3,60%	5,60%	1,22%	14,34%	36,43%	54,07%	

* 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.

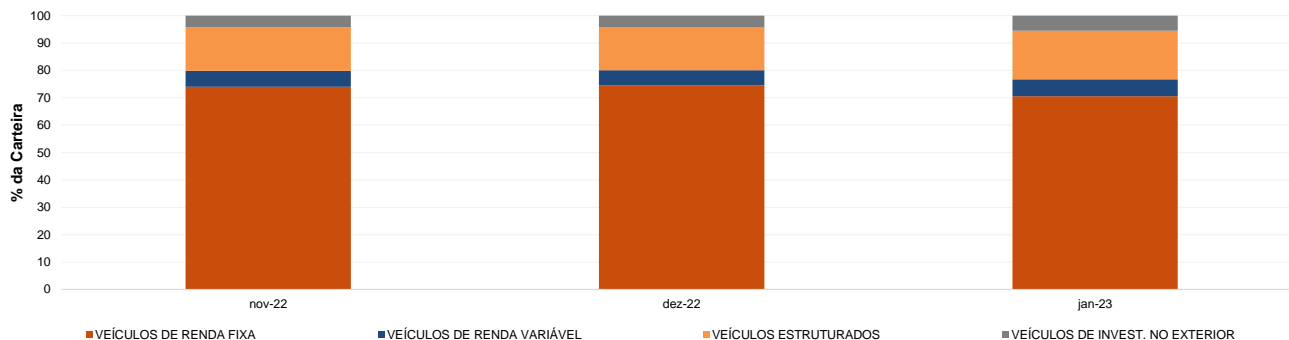
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

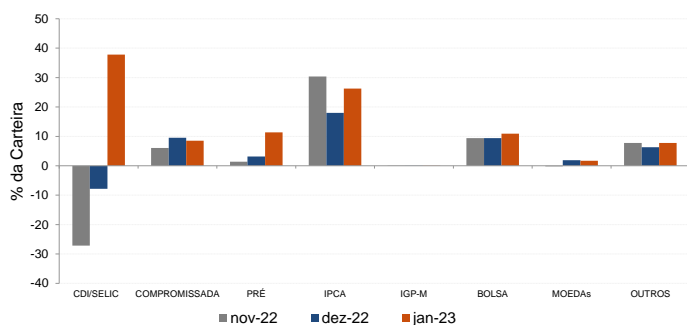
Distribuição da Carteira

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.

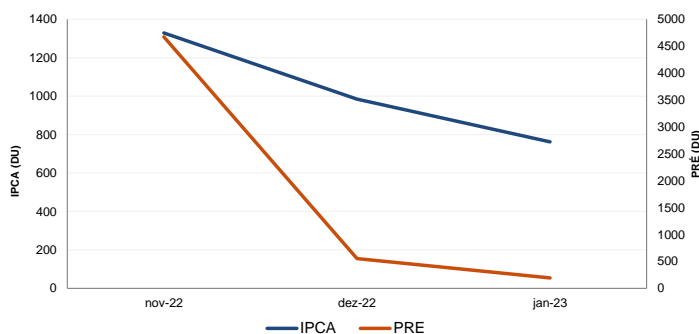
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
IDTP LN		953,28	6,75	19,36	0,14
VALE3	Mineração	601,49	4,26	691,19	5,18
EQTL3	Energia Elétrica	483,29	3,42	435,92	3,26
IGTI11	Exploração de Imóveis	460,99	3,26	431,41	3,23
ELET3	Energia Elétrica	437,72	3,10	436,08	3,27
SBSP3	Água e Saneamento	427,72	3,03	382,60	2,86
ENGI11	Energia Elétrica	415,91	2,94	466,33	3,49
RENT3	Diversos	398,72	2,82	348,20	2,61
ALSO3	Exploração de Imóveis	396,56	2,81	220,19	1,65
AURE3	Energia Elétrica	379,05	2,68	339,67	2,54

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

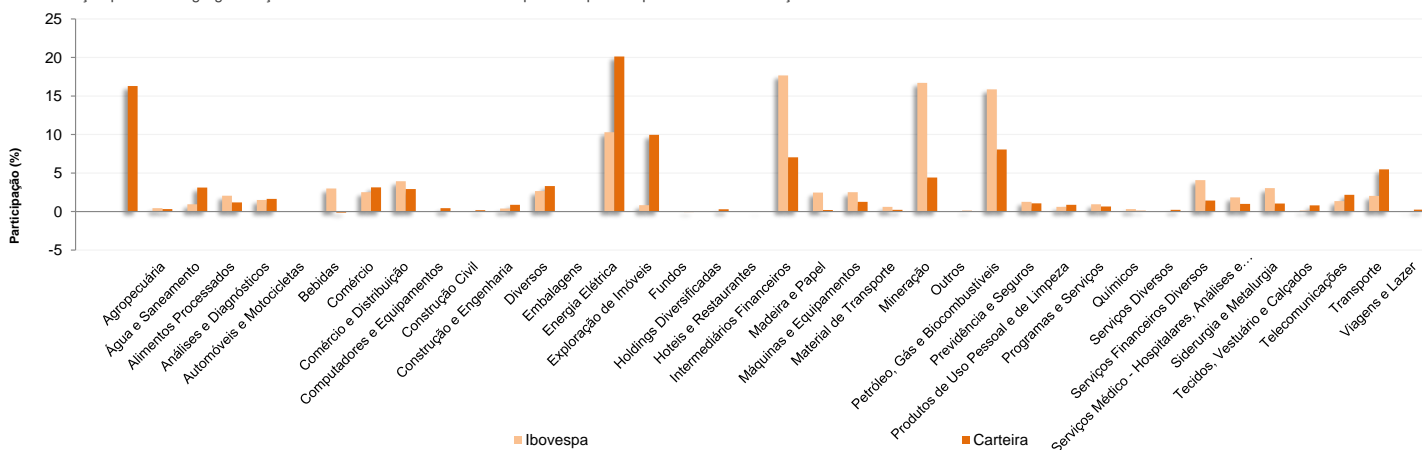
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	27,24	0,19	0,34	35
MTSA4	36,24	0,26	0,03	3
VALE3	601,49	4,26	0,00	1
EQTL3	483,29	3,42	0,00	1
IGTI11	460,99	3,26	0,00	1
ELET3	437,72	3,10	0,00	1
SBSP3	427,72	3,03	0,00	1
ENGI11	415,91	2,94	0,01	1
RENT3	398,72	2,82	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.



Análises de Contrapartes

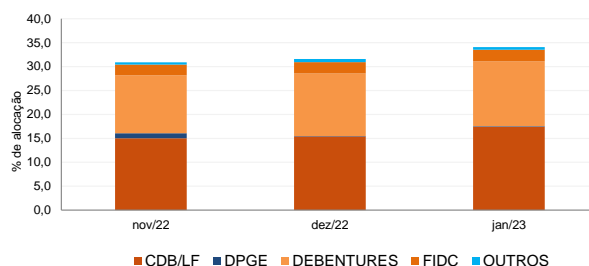
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.359,43	5,51	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.716,46	2,36	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.602,21	1,39	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.561,03	1,35	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.179,96	1,02	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	899,32	0,78	Faixa 1
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	863,63	0,75	Faixa 1
ENERGISA SA	854,95	0,74	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	685,08	0,59	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	683,90	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
BTOW15	0,19	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-dez-30	IPCA	7,05%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
CELG12	213,75	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	Sem Faixa	Faixa 1	20-jan-26	CDI	1,60%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA6	0,02	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-out-30	IPCA	7,50%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
LAMEA7	0,07	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	2,09%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LAMEA7	0,03	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	-0,07	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LAMEA7	0,00	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	35,70%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	33,54%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	35,70%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	0,00	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	35,70%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	24,73%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	0,00	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	24,73%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LAMEA7	10,12	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	17,57	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	0,27	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,83%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	1,16	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,95%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	1,86	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,95%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	1,90	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,95%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	0,14	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
TRIS17	8,50	TRISUL SA	Faixa 2	Faixa 3	15-dez-25	CDI	2,47%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 31/01/2023

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
ELDC14	20-set-24	662	0,00%	CDI	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	13-jan-23	2,03%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
ENEV19	15-set-32	5.953	0,01%	IPCA	ENEVA S.A	10-jan-23	7,64%	Faixa 1	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ENEV19	15-set-32	5.866	0,01%	IPCA	ENEVA S.A	10-jan-23	7,64%	Faixa 1	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LAMEA7	15-jul-50	72	0,00%	CDI	AMERICANAS S.A	16-jan-23	2,09%	Faixa 8	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LAMEA7	15-jul-50	-72	0,00%	CDI	AMERICANAS S.A	17-jan-23	295,01%	Faixa 8	CAPITÂNIA 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	485.804	0,42%	Selic		19-jan-23	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	294.039	0,25%	Selic		17-jan-23	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	294.039	0,25%	Selic		13-jan-23	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	25.569	0,02%	Selic		18-jan-23	0,01%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.400	0,00%	Selic		25-jan-23	0,01%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	932.981	0,81%	Selic		11-jan-23	0,02%	0,02%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	38.342	0,03%	Selic		25-jan-23	0,02%	0,02%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2027-03-01	01-mar-27	93.895	0,08%	Selic		12-jan-23	0,16%	0,17%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	80.481	0,07%	Selic		24-jan-23	0,16%	0,16%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	53.654	0,05%	Selic		13-jan-23	0,17%	0,17%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	37.558	0,03%	Selic		18-jan-23	0,17%	0,17%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	8.942	0,01%	Selic		17-jan-23	0,17%	0,17%	ITAÚ GERI RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	33.744	0,03%	PRE		27-jan-23	12,85%	13,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	28.120	0,02%	PRE		27-jan-23	12,85%	13,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	22.496	0,02%	PRE		27-jan-23	12,85%	13,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	22.496	0,02%	PRE		27-jan-23	12,85%	13,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.125	0,04%	IPCA		12-jan-23	5,88%	5,90%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	35.446	0,03%	IPCA		17-jan-23	6,21%	5,94%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	90.332	0,08%	IPCA		16-jan-23	6,61%	6,70%	PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	57.614	0,05%	IPCA		12-jan-23	6,65%	6,59%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	24.455	0,02%	IPCA		12-jan-23	6,22%	6,11%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	11.655	0,01%	IPCA		27-jan-23	5,98%	6,08%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	288.124	0,25%	IPCA		05-jan-23	6,55%	6,44%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	20.580	0,02%	IPCA		12-jan-23	6,13%	6,06%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	8.232	0,01%	IPCA		16-jan-23	6,04%	6,15%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	32.475	0,03%	IPCA		12-jan-23	6,05%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	233.360	0,20%	IPCA		06-jan-23	6,42%	6,30%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	155.573	0,13%	IPCA		06-jan-23	6,42%	6,30%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	155.573	0,13%	IPCA		06-jan-23	6,40%	6,30%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	77.787	0,07%	IPCA		06-jan-23	6,41%	6,30%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	77.787	0,07%	IPCA		06-jan-23	6,42%	6,30%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	93.410	0,08%	IPCA		16-jan-23	5,96%	6,04%	PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	857	0,00%	IPCA		09-jan-23	6,29%	6,25%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	65.858	0,06%	IPCA		16-jan-23	6,16%	6,26%	PACIFICO RF COMPOSTO FI RF LP
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	274	0,00%	IPCA		09-jan-23	6,38%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI