

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	4.966.624,11	100%				1,10%	3,33%		1,10%			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%
Renda Fixa	4.966.624,11	100%			0,01%							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.071.594,52	81,94%	ITAÚ	0,01%	0,01%	1,13%	3,30%	6,75%	1,13%	12,93%	18,70%	21,58%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	895.029,60	18,01%	ITAÚ	0,03%	0,02%	1,18%	3,59%	7,39%	1,18%	14,38%	21,64%	24,46%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%
Total	4.969.001,31	100%			0,01%	1,10%	3,30%		1,10%			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%

* 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.

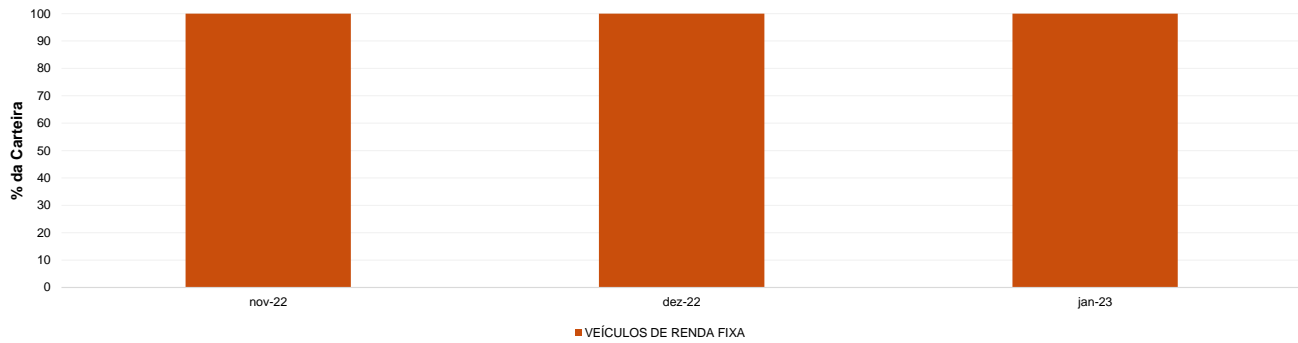
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

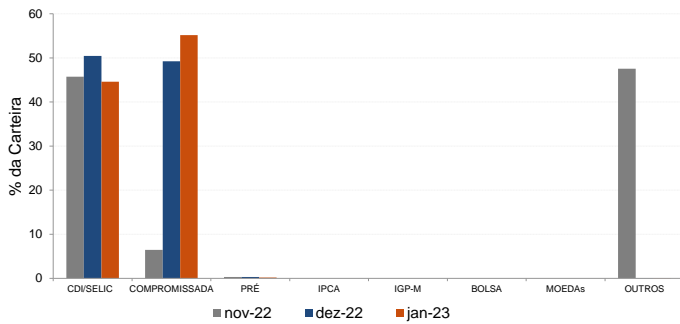
Distribuição da Carteira

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.

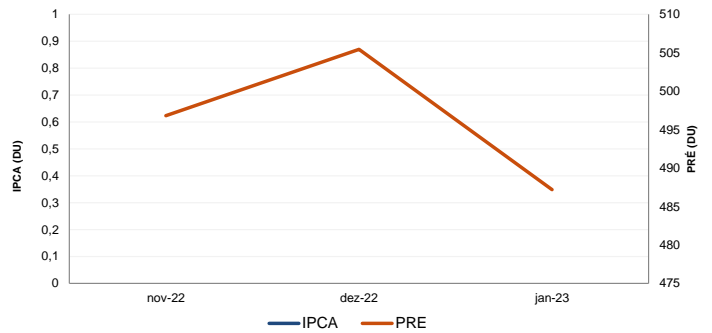
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

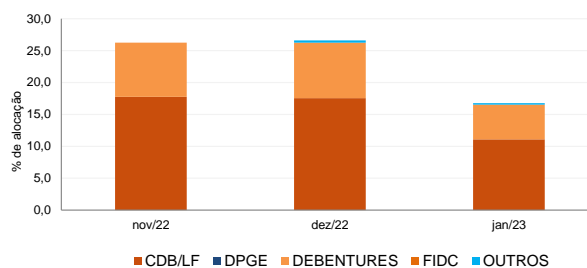
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	140,05	2,84	Faixa 1
BCO ITAU SA	73,16	1,48	Faixa 1
BCO SAFRA SA	68,47	1,39	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	39,58	0,80	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	33,36	0,68	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	32,78	0,67	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	22,38	0,45	Faixa 1
BANCO XP S.A	22,14	0,45	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	19,46	0,39	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	18,53	0,38	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.

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	37.397	0,76%	Selic	27-jan-23	0,02%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	21.340	0,43%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.021	0,06%	Selic	02-jan-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.968	0,04%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.049	0,02%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	770	0,02%	Selic	18-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	690	0,01%	Selic	18-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	640	0,01%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	601	0,01%	Selic	10-jan-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	563	0,01%	Selic	23-jan-23	0,02%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	276	0,01%	Selic	23-jan-23	0,02%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	242	0,00%	Selic	19-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	229	0,00%	Selic	19-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	219	0,00%	Selic	19-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	161	0,00%	Selic	18-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	155	0,00%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	108	0,00%	Selic	18-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	39	0,00%	Selic	18-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	33	0,00%	Selic	16-jan-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.007	0,02%	Selic	02-jan-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	63.562	1,29%	Selic	31-jan-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	603	0,01%	Selic	09-jan-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	30.004	0,61%	Selic	20-jan-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	45.493	0,92%	Selic	30-jan-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	12.919	0,26%	Selic	30-jan-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.746	0,08%	Selic	30-jan-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.331	0,03%	Selic	30-jan-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	433	0,01%	Selic	31-jan-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI