

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 28/02/2023

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
Renda Fixa	5.007.508,94	100%				0,85%	3,11%		1,96%			
Benchmark:	CDI					0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%
Renda Fixa	5.007.508,94	100%			0,01%							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.107.355,33	82,01%	ITAÚ	0,01%	0,02%	0,94%	3,22%	6,50%	2,08%	13,06%	19,68%	22,37%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	900.153,61	17,97%	ITAÚ	0,03%	0,02%	0,57%	3,00%	6,60%	1,76%	14,07%	22,15%	24,84%
Benchmark:	CDI					0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%
Total	5.008.511,60	100%			0,01%	0,85%	3,11%	6,56%	1,96%			
Benchmark:	CDI					0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%

* 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.

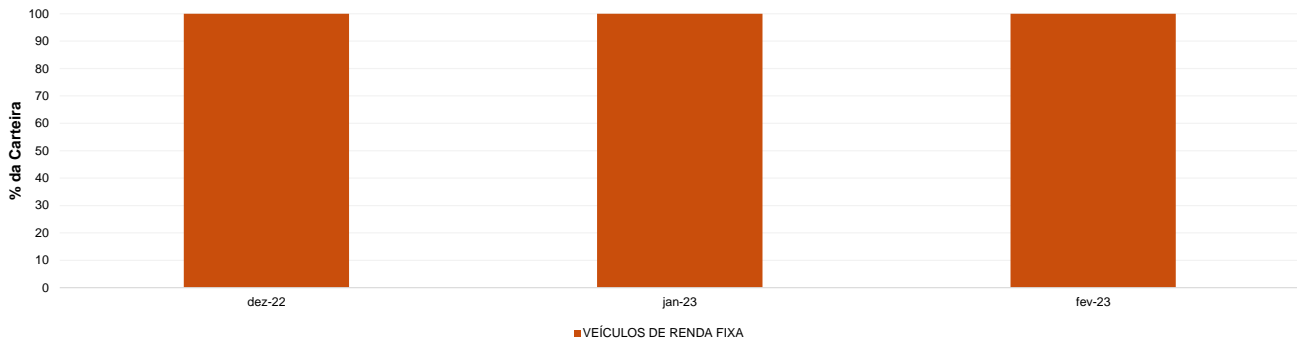
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

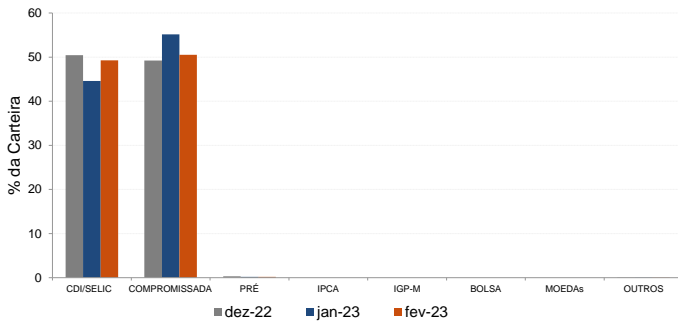
Distribuição da Carteira

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.

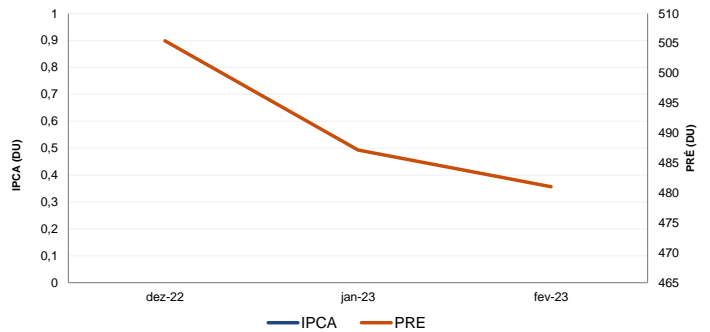
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

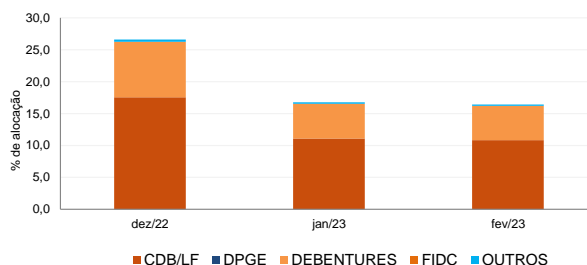
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	146,75	2,94	Faixa 1
BCO ITAU SA	76,63	1,53	Faixa 1
BCO SAFRA SA	71,71	1,44	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	41,47	0,83	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	34,94	0,70	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	28,50	0,57	Faixa 2
BANCO XP S.A	23,19	0,46	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	22,23	0,45	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	19,34	0,39	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	14,84	0,30	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
SULA29	4,79	SUL AMERICA SA	Faixa 3	Faixa 1	08-nov-28	CDI	1,70%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SULA29	2,66	SUL AMERICA SA	Faixa 3	Faixa 1	08-nov-28	CDI	1,46%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SULM28	0,10	SUL AMERICA SA	Faixa 3	Faixa 1	01-fev-26	CDI	1,51%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SULM28	1,34	SUL AMERICA SA	Faixa 3	Faixa 1	01-fev-26	CDI	1,80%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SULM28	0,21	SUL AMERICA SA	Faixa 3	Faixa 1	01-fev-26	CDI	1,80%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 28/02/2023

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
TUPY14	06-set-27	100	0,00%	CDI	TUPY SA	06-fev-23	1,54%	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	133.523	2,67%	Selic		01-fev-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	77.271	1,55%	Selic		03-fev-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.068	0,04%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.286	0,03%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	561	0,01%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	365	0,01%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	275	0,01%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	173	0,00%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-03-01	01-mar-23	82	0,00%	Selic		16-fev-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	86.279	1,73%	Selic		06-fev-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.438	0,11%	Selic		06-fev-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	56.470	1,13%	Selic		07-fev-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	7.850	0,16%	Selic		27-fev-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	999	0,02%	Selic		28-fev-23	0,13%	0,13%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	4.913	0,10%	Selic		06-fev-23	0,16%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	6.887	0,14%	Selic		06-fev-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI