

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2023

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 | 5.062.214,64 | 100% | | | 1,14% | 3,12% | 6,52% | 3,12% | | | | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,55% | 3,25% | 13,28% | 20,54% | 23,23% | |
| Renda Fixa | 5.062.214,64 | 100% | | 0,02% | | | | | | | | |
| ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI | 4.151.873,23 | 82,01% | ITAÚ | 0,01% | 0,02% | 1,17% | 3,27% | 6,59% | 3,27% | 13,33% | 20,87% | 23,38% |
| ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI | 910.341,41 | 17,98% | ITAÚ | 0,03% | 0,01% | 1,13% | 2,91% | 6,54% | 2,91% | 14,17% | 23,19% | 26,40% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,55% | 3,25% | 13,28% | 20,54% | 23,23% | |
| Total | 5.062.927,95 | 100% | | 0,02% | 1,14% | 3,12% | 6,47% | 3,12% | | | | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,55% | 3,25% | 13,28% | 20,54% | 23,23% | |

* 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.

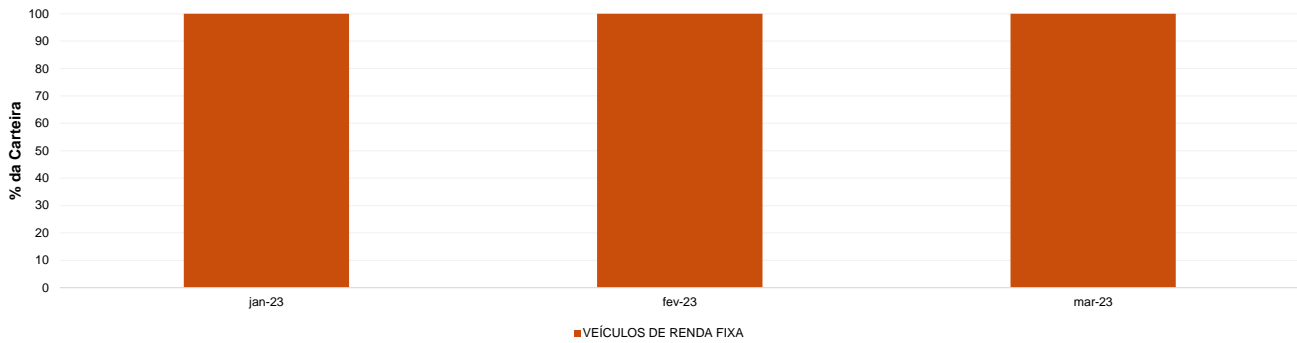
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

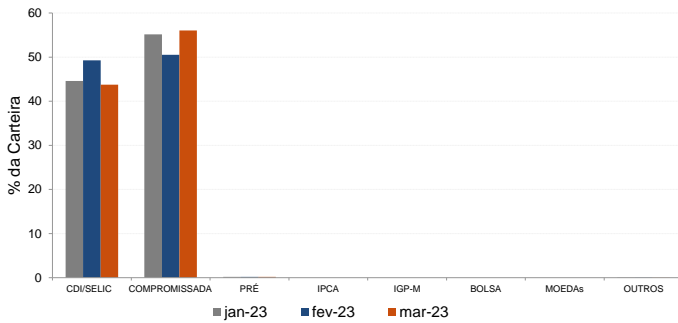
Distribuição da Carteira

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.

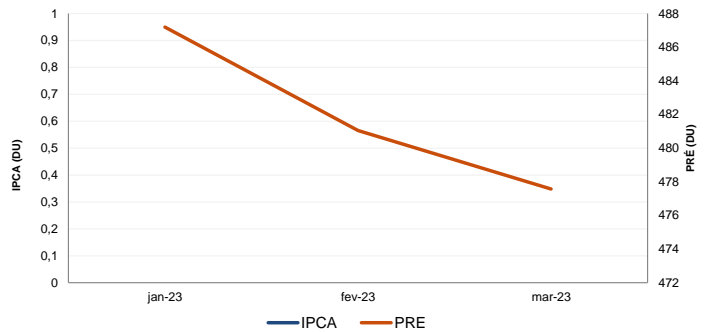
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

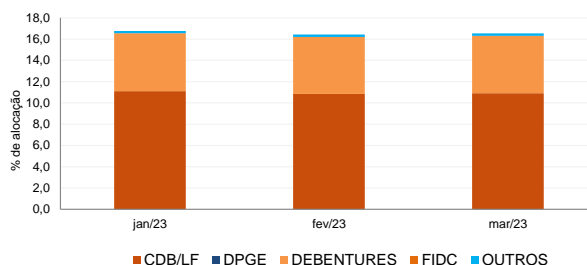
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--------------------------------------------|--------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 152,89 | 3,02 | Faixa 1 |
| BCO ITAU SA | 79,88 | 1,58 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 66,32 | 1,31 | Faixa 1 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 43,24 | 0,86 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA) | 36,42 | 0,72 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 29,71 | 0,59 | Faixa 2 |
| BANCO XP S.A | 24,18 | 0,48 | Faixa 2 |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 23,32 | 0,46 | Faixa 1 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 20,14 | 0,40 | Faixa 1 |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 15,46 | 0,31 | 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 |
|------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|-------|--------|------|---------|
|------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|-------|--------|------|---------|

Nenhuma mudança de faixa encontrada.

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2023

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 Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|--------|-----------------|-----------|-------------|--------------|----------------|----------------------------|
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 643 | 0,01% | Selic | 13-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 365 | 0,01% | Selic | 31-mar-23 | 0,01% | 0,02% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 182 | 0,00% | Selic | 31-mar-23 | 0,01% | 0,02% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 137 | 0,00% | Selic | 27-mar-23 | 0,00% | 0,01% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 4.963 | 0,10% | Selic | 29-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 895 | 0,02% | Selic | 29-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 4 | 0,00% | Selic | 29-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 1 | 0,00% | Selic | 29-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 27.641 | 0,55% | Selic | 03-mar-23 | 0,01% | 0,01% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 11.891 | 0,24% | Selic | 23-mar-23 | 0,00% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 9.209 | 0,18% | Selic | 06-mar-23 | 0,01% | 0,01% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 6.453 | 0,13% | Selic | 02-mar-23 | 0,01% | 0,01% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 7.369 | 0,15% | Selic | 06-mar-23 | 0,03% | 0,03% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 45.734 | 0,90% | Selic | 22-mar-23 | 0,09% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 36.729 | 0,73% | Selic | 15-mar-23 | 0,09% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 36.492 | 0,72% | Selic | 29-mar-23 | 0,10% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 33.116 | 0,66% | Selic | 08-mar-23 | 0,08% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 11.047 | 0,22% | Selic | 06-mar-23 | 0,08% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2026-09-01 | 01-set-26 | 2.761 | 0,05% | Selic | 06-mar-23 | 0,08% | 0,08% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 8.244 | 0,16% | Selic | 20-mar-23 | 0,15% | 0,15% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 6.444 | 0,13% | Selic | 03-mar-23 | 0,13% | 0,13% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 45 | 0,00% | Selic | 07-mar-23 | 0,13% | 0,13% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-09-01 | 01-set-27 | 18.401 | 0,36% | Selic | 03-mar-23 | 0,13% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-09-01 | 01-set-27 | 9.160 | 0,18% | Selic | 20-mar-23 | 0,15% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-09-01 | 01-set-27 | 4.602 | 0,09% | Selic | 03-mar-23 | 0,13% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2027-09-01 | 01-set-27 | 45 | 0,00% | Selic | 07-mar-23 | 0,13% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2029-03-01 | 01-mar-29 | 27.448 | 0,54% | Selic | 22-mar-23 | 0,18% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |
| LFT 2029-03-01 | 01-mar-29 | 18.220 | 0,36% | Selic | 08-mar-23 | 0,17% | 0,00% | ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI |

