

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 28/04/2023

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	124.713.117,14	94,36%				0,70%	2,83%	6,19%	3,87%				
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	85.862.723,89	64,96%											
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF	85.862.723,89	64,96%		100%	0,24%	0,66%	3,03%	6,67%	4,30%	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
RF CRÉDITO	19.858.309,05	15,02%											
PENSION FI RF CRED PRIV	7.334.719,58	5,55%	SAFRA	8,61%	0,01%	0,88%	2,78%	6,53%	3,90%	14,52%	27,88%	-	
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	3.221.622,61	2,44%	ARX	1,68%	0,03%	0,73%	1,33%	3,94%	1,55%	-	-	-	
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	601.202,72	0,45%	AUGME	0,25%	0,18%	0,84%	2,24%	2,02%	-0,29%	9,75%	22,23%	30,77%	
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	8.127.511,24	6,15%	CAPITANIA CAPITAL	10,15%	0,13%	0,50%	1,18%	2,52%	0,19%	9,92%	21,58%	-	
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	573.252,91	0,43%	CAPTALYS	0,07%	0,00%	1,24%	1,35%	-4,03%	-2,89%	-3,55%	5,92%	15,66%	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
RF REFERENCIADO DI	10.273.267,49	7,77%											
BRDESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	10.273.267,49	7,77%	BRDESCO	0,10%	0,03%	0,88%	2,96%	6,29%	4,09%	13,10%	20,96%	23,04%	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
RF	8.333.114,94	6,30%											
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	8.333.114,94	6,30%	ITAÚ	0,51%	0,66%	0,83%	3,55%	5,49%	4,69%	11,10%	21,11%	25,27%	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
FIDC	385.701,77	0,29%											
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	21.382,14	0,02%	BNY MELLON	1,19%		1,20%	3,97%	8,46%	5,49%	17,72%	28,67%	32,27%	
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	62.544,25	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	301.775,38	0,23%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
Estruturado	7.528.351,49	5,70%											
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,13%	3,76%	7,99%	5,19%	16,76%	28,76%	35,44%	
MM FIC	4.974.944,33	3,76%											
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	4.974.944,33	3,76%	ITAÚ	1,03%	2,23%	0,50%	0,14%	1,62%	1,22%	10,86%	-	-	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
MM MACRO	2.553.407,17	1,93%											
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.553.407,17	1,93%	ITAÚ	0,82%	2,51%	0,36%	1,11%	2,36%	2,70%	9,43%	23,21%	-	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
Total	132.171.935,49	100%				0,22%	0,79%	2,74%	5,95%	3,71%	12,81%	21,42%	26,86%
Benchmark:	IPCA + 7,2% a.a.					1,11%	3,85%	7,36%	5,04%	11,66%	34,18%	53,48%	

* 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.

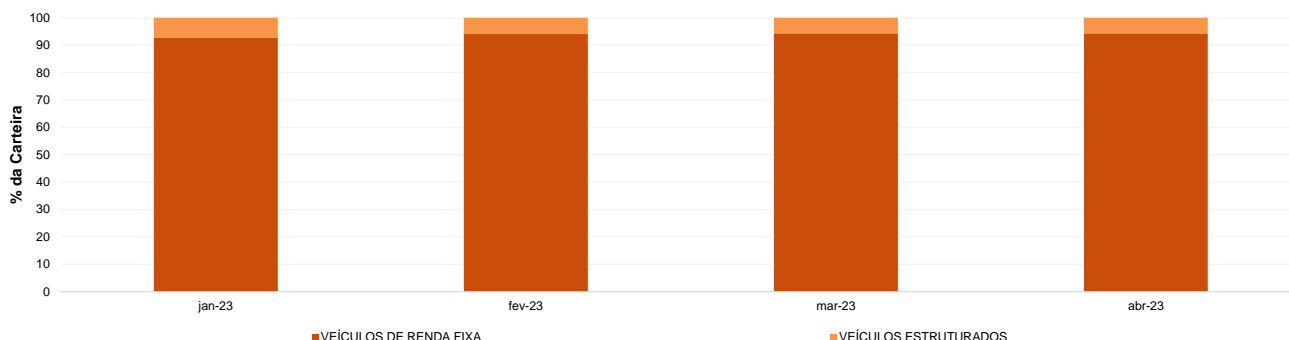
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

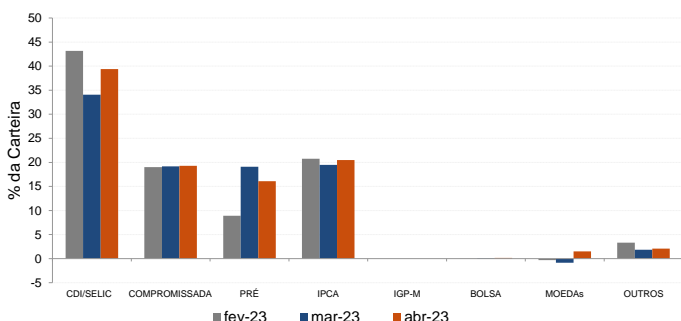
Distribuição da Carteira

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.

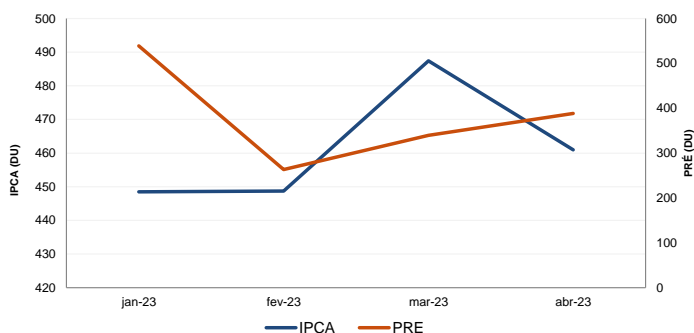
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	78,44	8,88	89,66	10,93
ELET3	Energia Elétrica	76,64	8,68	68,02	8,29
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	74,38	8,42	53,26	6,49
EQTL3	Energia Elétrica	72,33	8,19	59,46	7,25
CIEL3	Serviços Financeiros Diversos	69,50	7,87	36,74	4,48
ITUB4	Intermediários Financeiros	58,29	6,60	58,59	7,14
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	56,98	6,45	59,94	7,31
SBSP3	Água e Saneamento	56,73	6,42	65,39	7,97
BBAS3	Intermediários Financeiros	41,99	4,75	44,90	5,47
GOAU4	Siderurgia e Metalurgia	33,72	3,82	33,95	4,14

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

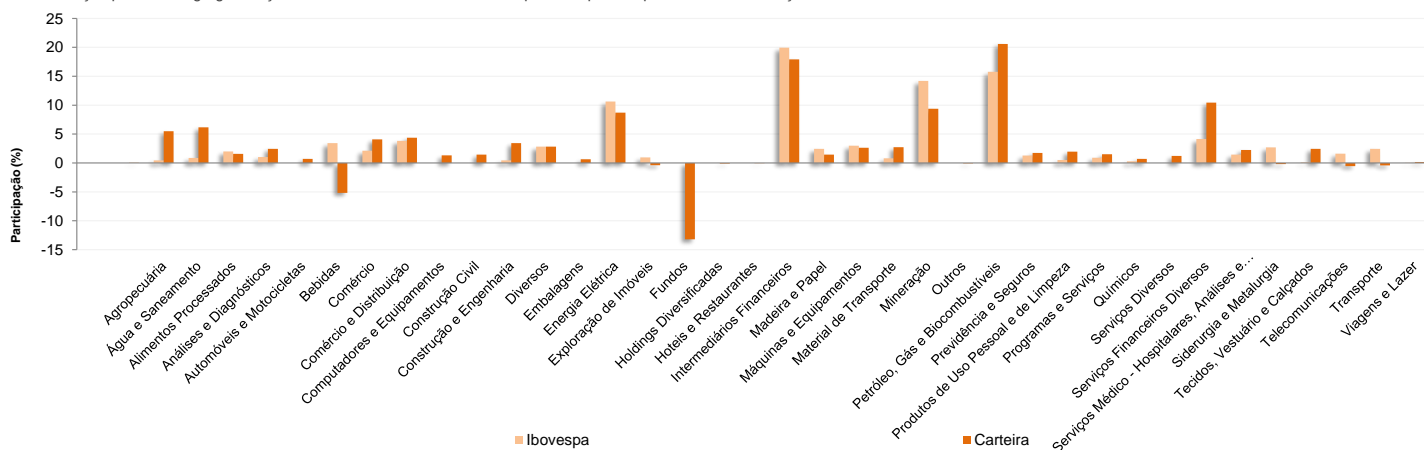
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	78,44	8,88	0,00	1
ELET3	76,64	8,68	0,00	1
PRI03	74,38	8,42	0,00	1
EQTL3	72,33	8,19	0,00	1
CIEL3	69,50	7,87	0,00	1
ITUB4	58,29	6,60	0,00	1
PETR4	56,98	6,45	0,00	1
SBSP3	56,73	6,42	0,00	1
BBAS3	41,99	4,75	0,00	1
GOAU4	33,72	3,82	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

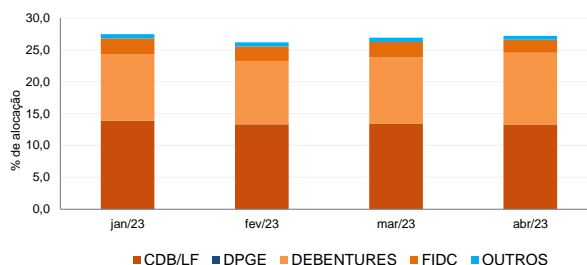
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.233,98	3,21	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.124,48	1,61	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.849,21	1,40	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.540,72	1,17	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.045,16	0,79	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	617,55	0,47	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	566,79	0,43	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	556,02	0,42	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	553,26	0,42	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	506,35	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
CSAN15	27,41	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-abr-28	CDI	2,40%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP
CSAN15	27,27	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-abr-28	CDI	2,50%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-50	CDI	2,51%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-50	CDI	2,51%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-50	CDI	2,51%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	12,41	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	3,56	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	6,89	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHC3	2,55	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-26	CDI	1,55%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHC3	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,38%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHD3	-0,11	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,71%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	-0,11	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,71%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	87,71	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-28	CDI	2,34%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	15,68	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-28	CDI	2,62%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
SAPRC1	185,91	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	Sem Faixa	Faixa 1	15-abr-28	CDI	1,90%	PENSION FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 28/04/2023

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
ARML13	04-nov-29	125.148	0,09%	CDI	ARMAC LOCAÇÃO, LOGÍSTICA E SERVIÇOS	26-abr-23	2,72%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	93.938	0,07%	CDI	BRASKEM SA	20-abr-23	5,57%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	46.911	0,04%	CDI	BRASKEM SA	27-abr-23	5,58%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CRI RBRA 25 1	20-mar-28	6.667	0,01%	CDI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	17-abr-23	6,00%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CSAN15	20-abr-28	27.413	0,02%	CDI	COSAN SA	28-abr-23	2,40%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
CSAN23	15-ago-31	91.733	0,07%	CDI	COSAN SA	13-abr-23	2,33%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CSNAA2	20-dez-27	56.096	0,04%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	13-abr-23	2,95%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
DASAC5	30-out-31	118.983	0,09%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	26-abr-23	2,72%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
GRRB14	15-jul-26	81.418	0,06%	CDI	AGUAS GUARIROBA SA	13-abr-23	2,67%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	-110	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	03-abr-23	2,71%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	-110	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	03-abr-23	2,71%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OMGE13	15-mar-29	101.497	0,08%	CDI	OMEGA GERACAO SA	27-abr-23	2,66%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ONCO19	25-nov-27	69.895	0,05%	CDI	ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDI	24-abr-23	3,47%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OUSA10	20-jun-26	120.047	0,09%	CDI	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	27-abr-23	2,56%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RDCO10	15-dez-26	101.531	0,08%	CDI	RODOVIAS COLINAS SA	27-abr-23	2,25%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SAPRC1	15-abr-28	185.910	0,14%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SAN	28-abr-23	1,90%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
UNIP17	13-out-28	44.475	0,03%	CDI	UNIPAR CARBOCLORO SA	13-abr-23	2,22%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
USIM39	09-dez-32	68.331	0,05%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	26-abr-23	2,15%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VERO12	17-mar-30	59.979	0,05%	IPCA	VERO S.A.	17-abr-23	9,75%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VIXL15	26-out-26	119.015	0,09%	CDI	VIX LOGISTICA SA	27-abr-23	2,38%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
XXII11	26-ago-25	31.659	0,02%	CDI	TRAVESSIA SECURITIZADORA DE CRÉDIT	27-abr-23	6,33%	Sem Faixa	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	40.061	0,03%	Selic		12-abr-23	0,02%	0,01%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	26.974	0,02%	Selic		13-abr-23	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	5.834	0,00%	Selic		12-abr-23	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	667	0,00%	Selic		12-abr-23	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	399.225	0,30%	Selic		19-abr-23	0,11%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	196.600	0,15%	Selic		12-abr-23	0,10%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2026-03-01	01-mar-26	65.533	0,05%	Selic		04-abr-23	0,10%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2026-03-01	01-mar-26	41.228	0,03%	Selic		28-abr-23	0,12%	0,00%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LFT 2027-03-01	01-mar-27	9.289	0,01%	Selic		10-abr-23	0,15%	0,15%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	6.767	0,01%	Selic		12-abr-23	0,15%	0,16%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	6.369	0,00%	Selic		10-abr-23	0,15%	0,15%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2029-03-01	01-mar-29	133.209	0,10%	Selic		17-abr-23	0,19%	0,00%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	108.108	0,08%	PRE		12-abr-23	11,89%	11,85%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	36.036	0,03%	PRE		14-abr-23	11,83%	11,87%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	2.556	0,00%	IPCA		27-abr-23	5,79%	5,82%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	130	0,00%	IPCA		27-abr-23	5,78%	5,82%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	117.621	0,09%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	88.216	0,07%	IPCA		24-abr-23	5,81%	5,78%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	88.216	0,07%	IPCA		24-abr-23	5,82%	5,78%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	71.413	0,05%	IPCA		20-abr-23	5,81%	5,80%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	71.413	0,05%	IPCA		20-abr-23	5,80%	5,80%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	37.807	0,03%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	12.602	0,01%	IPCA		03-abr-23	5,92%	5,89%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (