

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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	85.002.349,25	72,85%				0,64%	2,65%	3,56%	3,42%				
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	55.476.174,57	47,55%											
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	55.476.174,57	47,55%		100%	0,15%	0,47%	2,23%	0,69%	3,22%	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
RF CRÉDITO	18.630.287,84	15,97%											
PENSION FI RF CRED PRIV	7.863.622,09	6,74%	SAFRA	9,23%	0,01%	0,88%	2,78%	6,53%	3,90%	14,52%	27,88%	-	
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	7.283.228,57	6,24%	ARX	3,80%	0,03%	0,73%	1,33%	3,94%	1,55%	-	-	-	
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	897.786,98	0,77%	AUGME	0,38%	0,18%	0,84%	2,24%	2,02%	-0,29%	9,75%	22,23%	30,77%	
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2.154.420,79	1,85%	CAPITANIA CAPITAL	2,69%	0,13%	0,50%	1,18%	2,52%	0,19%	9,92%	21,58%	-	
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	431.229,42	0,37%	CAPTALYS	0,05%	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	5.969.204,35	5,12%											
GERI TENAX FI RF LP	2.985.910,62	2,56%	TENAX CAPITAL	6,79%	1,19%	1,40%	5,65%	6,83%	6,49%	12,02%	15,24%	20,73%	
ITAÚ GERI RF FI	2.983.293,74	2,56%	ITAÚ	7,05%	1,29%	1,50%	4,89%	5,10%	5,44%	10,17%	6,99%	9,03%	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
RF	4.415.639,30	3,78%											
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.415.639,30	3,78%	ITAÚ	0,27%	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	511.043,18	0,44%											
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	69.504,99	0,06%	AVANTGARDE	0,00%	-	-	-	-	-	-	-	-	
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	423.323,78	0,36%	OLIVEIRA TRUST	0,00%	-	-	-	-	-	-	-	-	
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.214,41	0,02%	BNY MELLON	1,01%	-	1,20%	3,97%	8,46%	5,49%	17,72%	28,67%	32,27%	
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
Renda Variável	5.237.639,09	4,49%				2,17%	-8,38%	-9,94%	-5,90%				
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					2,72%	-7,29%	-8,69%	-3,92%	-0,30%	-6,84%	41,68%	
RV VALOR	1.981.537,51	1,70%											
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	854.621,88	0,73%	ABSOLUTO PARTNERS	0,27%	9,74%	3,53%	-8,99%	-20,81%	-5,31%	-13,39%	-39,46%	-6,09%	
BOGARI VALUE T INSTIT. FIC FIA	402.852,98	0,35%	BOGARI	4,18%	9,91%	1,15%	-13,81%	-27,12%	-11,99%	-26,10%	-	-	
KIRON INSTIT. FIA	388.366,13	0,33%	KIRON CAPITAL	0,85%	7,94%	0,64%	-11,51%	-21,84%	-9,45%	-7,69%	-23,25%	8,01%	
LIS VALUE FIA	335.696,52	0,29%	LIS CAPITAL	0,21%	4,28%	-0,85%	-8,15%	-17,89%	-7,88%	-16,37%	-27,74%	-2,54%	
Benchmark:	IBOVESPA					2,50%	-7,93%	-10,00%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	
RV PASSIVO	1.432.174,57	1,23%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.432.174,57	1,23%	BLACKROCK	0,01%	7,80%	2,45%	-8,14%	-10,03%	-4,77%	-2,42%	-11,80%	30,10%	
Benchmark:	IBOVESPA					2,50%	-7,93%	-10,00%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	
RV ATIVO	903.299,30	0,77%											
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	281.244,67	0,24%	OCEANA	0,08%	7,90%	2,72%	-7,47%	-10,67%	-4,13%	-0,96%	-5,53%	36,42%	
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	333.795,67	0,29%	AZ QUEST	0,13%	5,77%	2,12%	-9,11%	-14,00%	-5,70%	-8,74%	-22,70%	10,20%	
XP INVESTOR FIA	288.258,96	0,25%	XP	0,15%	6,55%	3,10%	-4,63%	-12,34%	-1,33%	0,93%	-6,12%	30,38%	
Benchmark:	IBOVESPA					2,50%	-7,93%	-10,00%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	
RV SMALL CAP	527.928,23	0,45%											
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	527.928,23	0,45%	AZ QUEST	0,07%	4,45%	1,75%	-6,29%	-14,83%	-3,81%	-12,16%	-25,51%	10,73%	
Benchmark:	SMLL					1,91%	-10,40%	-20,60%	-7,78%	-19,88%	-36,55%	-1,08%	
RV LONG BIAS	449.740,65	0,39%											
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	449.740,65	0,39%	SHARP	0,91%	3,36%	2,85%	-4,47%	-5,74%	-1,28%	6,09%	-0,35%	-	
Benchmark:	IBOVESPA					2,50%	-7,93%	-10,00%	-4,83%	-3,19%	-12,16%	29,72%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	-57.041,17	-0,05%											
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	-57.041,17	-0,05%		100%	-464,07%	2,45%	-8,14%	-2,87%	-4,77%	-	-	-	
Benchmark:	IBX					1,93%	-8,69%	-10,82%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	
Estruturado	20.178.242,82	17,29%				1,46%	1,08%	0,36%	2,62%				
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,13%	3,76%	7,99%	5,19%	16,76%	28,76%	35,44%	

* 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.

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
MM MACRO	13.245.285,95	11,35%											
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIIMEN	4.229.068,57	3,62%	ITAÚ	3,16%	1,76%	0,80%	2,02%	4,53%	3,31%	15,46%	38,62%	-	
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.478.745,39	2,12%	ITAÚ	0,80%	2,51%	0,36%	1,11%	2,36%	2,70%	9,43%	23,21%	-	
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	316.844,24	0,27%	IBIUNA	0,01%	2,48%	1,29%	-1,76%	-1,35%	-0,38%	5,64%	27,05%	39,55%	
SOLANA EQ.HEDG. VIII FIC FI MULT	782.765,90	0,67%	SOLANA	1,21%	2,31%	-1,07%	-4,88%	-8,38%	-4,75%	6,14%	8,69%	-	
CLAVE ALPHA MACRO II FIC FI MULT	100.778,29	0,09%	CLAVE	0,02%	1,87%	0,81%	1,55%	6,21%	3,07%	14,26%	-	-	
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1.189.385,16	1,02%	SPX	1,73%	2,84%	0,40%	0,12%	-3,16%	1,96%	5,69%	28,51%	42,49%	
GENOA TL FIC FI MULT	799.182,26	0,68%	GENOA	0,65%	1,24%	0,85%	4,74%	5,93%	4,74%	17,91%	38,15%	-	
KAPITALO ZETA FIC FI MULT	598.659,03	0,51%	KAPITALO	0,03%	21,18%	-0,29%	0,07%	5,08%	2,54%	13,76%	30,31%	55,69%	
NW3 EVENT DRIVEN PLUS FIC FI MULT	427.293,77	0,37%	NW3	0,17%	1,56%	1,43%	1,63%	2,10%	2,11%	10,96%	21,71%	28,91%	
RPS TOTAL RETURN FIC FI MULT D30 TAG	545.814,83	0,47%	RPS CAPITAL	1,65%	6,16%	-0,53%	-4,99%	-3,57%	-4,12%	-1,46%	-0,04%	14,21%	
CLAVE ALPHA MACRO FIC FI MULT	708.824,69	0,61%	CLAVE	0,25%	1,87%	0,81%	1,55%	6,22%	3,08%	14,28%	27,56%	-	
VISTA HEDGE D30 FIC FI MULT	515.603,62	0,44%	VISTA	0,11%	1,05%	0,05%	-3,39%	-5,96%	-1,79%	-4,75%	-	-	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	552.320,22	0,47%	ZEITGEIST	0,04%	2,71%	1,46%	-0,75%	-1,43%	-0,03%	2,42%	19,94%	19,52%	
Benchmark:	CDI						0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%
MM FIC	6.932.956,86	5,94%											
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	2.598.840,85	2,23%	ITAÚ	0,54%	2,23%	0,50%	0,14%	1,62%	1,22%	10,86%	-	-	
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4.334.116,01	3,71%	ITAÚ	1,13%	7,02%	5,14%	3,16%	-4,36%	6,03%	1,92%	-	-	
Benchmark:	CDI						0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%
Exterior	6.327.977,67	5,42%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)						0,00%	-0,14%	5,89%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.397.736,20	4,63%											
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	566.416,97	0,49%	ITAÚ	1,02%	3,79%	-0,96%	-1,10%	6,04%	-0,01%	0,20%	-12,94%	-	
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.831.319,23	4,14%	TAG INVEST	10,97%	3,94%	-1,14%	-1,88%	1,88%	-3,16%	1,54%	-12,01%	-	
Benchmark:	CDI						0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%
RF INVESTIMENTO NO EXTERIOR	930.241,47	0,80%											
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	930.241,47	0,80%	ITAÚ	2,37%	4,40%	-1,55%	-0,35%	0,37%	-2,31%	-4,29%	-11,69%	-8,28%	
Benchmark:	CDI						0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%
Total	116.680.871,04	100%											
Benchmark:	IPCA + 8.1% a.a.						1,17%	4,06%	7,80%	5,32%	12,59%	36,43%	57,35%

* 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.

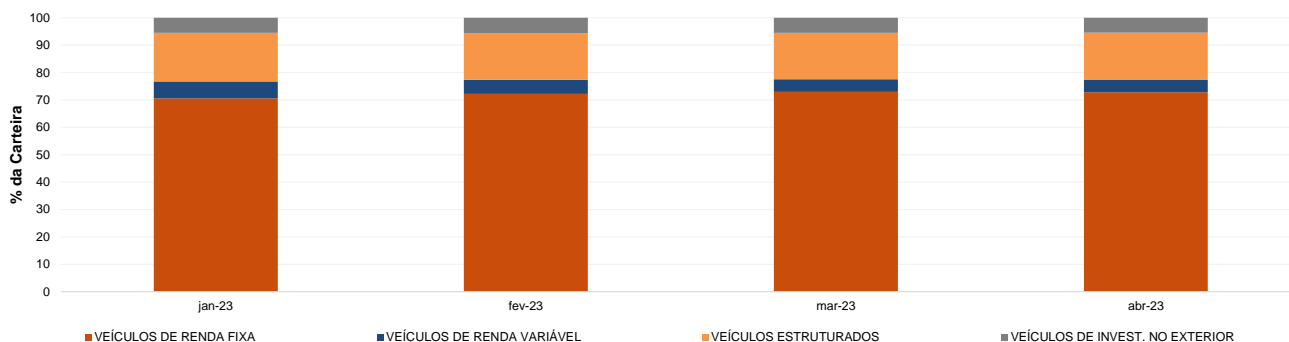
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

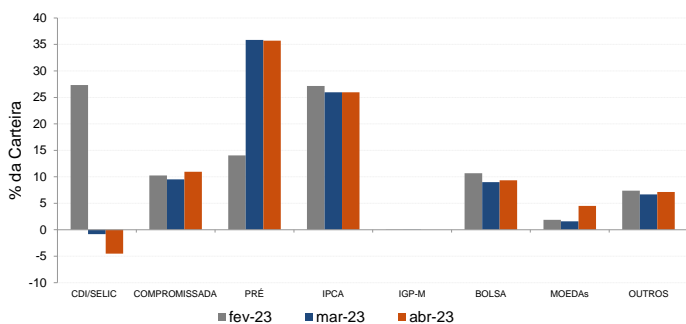
Distribuição da Carteira

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.

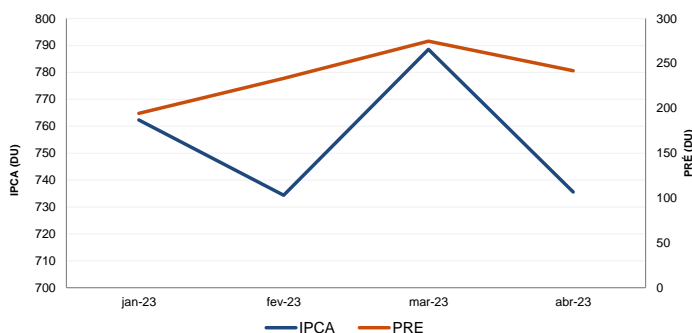
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de 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*	%
IDTP LN		948,21	7,51	961,60	7,76
EQTL3	Energia Elétrica	523,82	4,15	530,67	4,28
IGTI11	Exploração de Imóveis	491,37	3,89	467,12	3,77
ENGI11	Energia Elétrica	446,30	3,54	429,89	3,47
VALE3	Mineração	444,59	3,52	525,56	4,24
ALSO3	Exploração de Imóveis	422,37	3,35	375,59	3,03
ITUB4	Intermediários Financeiros	366,07	2,90	423,93	3,42
ELET3	Energia Elétrica	351,09	2,78	290,11	2,34
RENT3	Diversos	329,58	2,61	339,81	2,74
CPFE3	Energia Elétrica	328,42	2,60	320,79	2,59

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

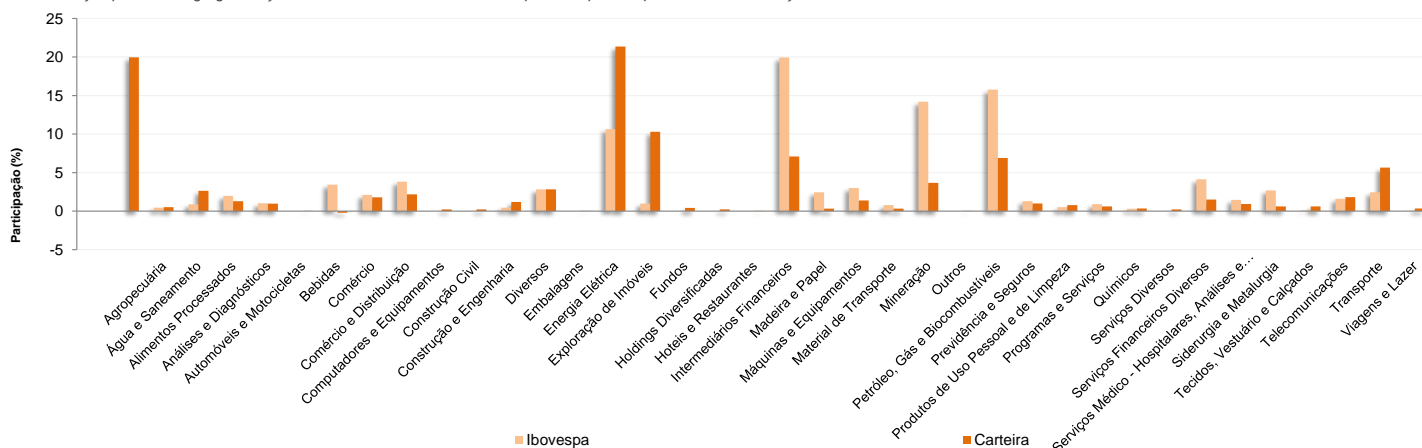
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	30,84	0,24	0,42	28
MTSA4	42,14	0,33	0,04	3
SCAR3	23,44	0,19	0,01	2
EQTL3	523,82	4,15	0,00	1
IGTI11	491,37	3,89	0,00	1
ENGI11	446,30	3,54	0,01	1
VALE3	444,59	3,52	0,00	1
ALSO3	422,37	3,35	0,01	1
ITUB4	366,07	2,90	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

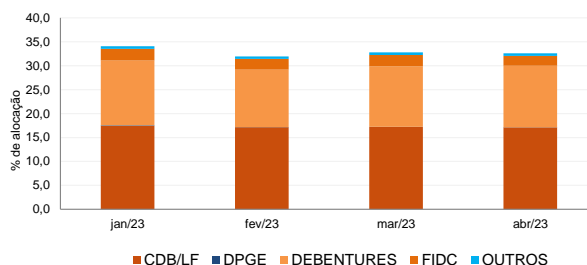
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.494,02	5,64	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.731,30	2,37	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.569,65	1,36	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.532,75	1,33	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	957,29	0,83	Faixa 1
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	877,53	0,76	Faixa 1
ENERGISA SA	870,63	0,76	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	724,63	0,63	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	713,92	0,62	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	651,15	0,57	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
CSAN15	28,51	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-abr-28	CDI	2,40%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF
CSAN15	61,65	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-abr-28	CDI	2,50%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	8,05	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB4	15,57	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	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	28,06	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	1,57%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHB6	0,03	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	104,03%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LIGHB6	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	118,43%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LIGHB6	0,01	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	118,43%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LIGHB6	0,01	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-abr-24	CDI	118,43%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
LIGHC3	0,00	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,38%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHC3	5,76	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-26	CDI	1,55%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LIGHD3	-0,03	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,71%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	-0,03	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-50	CDI	2,71%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	23,25	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-28	CDI	2,34%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LIGHD3	4,16	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Faixa 5	Faixa 8	15-out-28	CDI	2,62%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
SAPRC1	199,32	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	Sem Faixa	Faixa 1	15-abr-28	CDI	1,90%	PENSION FI RF CRED PRIV

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	33.174	0,03%	CDI	ARMAC LOCAÇÃO, LOGÍSTICA E SERVIÇOS	26-abr-23	2,72%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	24.901	0,02%	CDI	BRASKEM SA	20-abr-23	5,57%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
BRKMA8	09-nov-29	12.435	0,01%	CDI	BRASKEM SA	27-abr-23	5,58%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CRI RBRA 25 1	20-mar-28	9.956	0,01%	CDI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	17-abr-23	6,00%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CSAN15	20-abr-28	28.509	0,02%	CDI	COSAN SA	28-abr-23	2,40%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
CSAN23	15-ago-31	24.316	0,02%	CDI	COSAN SA	13-abr-23	2,33%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CSNAA2	20-dez-27	14.870	0,01%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	13-abr-23	2,95%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
DASAC5	30-out-31	31.540	0,03%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	26-abr-23	2,72%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
GRRB14	15-jul-26	21.582	0,02%	CDI	AGUAS GUARIROBA SA	13-abr-23	2,67%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	-29	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	03-abr-23	2,71%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	-29	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	03-abr-23	2,71%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OMGE13	15-mar-29	26.905	0,02%	CDI	OMEGA GERACAO SA	27-abr-23	2,66%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ONCO19	25-nov-27	18.527	0,02%	CDI	ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDIC	24-abr-23	3,47%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OUSA10	20-jun-26	31.822	0,03%	CDI	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	27-abr-23	2,56%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RDCO10	15-dez-26	26.914	0,02%	CDI	RODOVIAS COLINAS SA	27-abr-23	2,25%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
SAPRC1	15-abr-28	199.315	0,17%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SAN	28-abr-23	1,90%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
UNIP17	13-out-28	11.789	0,01%	CDI	UNIPAR CARBOCLORO SA	13-abr-23	2,22%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
USIM39	09-dez-32	18.113	0,02%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	26-abr-23	2,15%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VERO12	17-mar-30	15.899	0,01%	IPCA	VERO S.A.	17-abr-23	9,75%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
VIXL15	26-out-26	31.548	0,03%	CDI	VIX LOGISTICA SA	27-abr-23	2,38%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
XXII11	26-ago-25	8.392	0,01%	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 2025-03-01	01-mar-25	262.891	0,23%	Selic		12-abr-23	0,02%	0,02%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	92.012	0,08%	Selic		06-abr-23	0,02%	0,02%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	65.723	0,06%	Selic		03-abr-23	0,01%	0,02%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2026-03-01	01-mar-26	10.929	0,01%	Selic		28-abr-23	0,12%	0,00%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LFT 2029-03-01	01-mar-29	70.586	0,06%	Selic		17-abr-23	0,19%	0,00%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	57.285	0,05%	PRE		12-abr-23	11,89%	11,85%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	19.095	0,02%	PRE		14-abr-23	11,83%	11,87%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	892	0,00%	IPCA		28-abr-23	6,20%	5,90%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	872	0,00%	IPCA		28-abr-23	6,10%	6,69%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.354	0,00%	IPCA		27-abr-23	5,79%	5,82%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	69	0,00%	IPCA		27-abr-23	5,78%	5,82%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	130.223	0,11%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	92.416	0,08%	IPCA		24-abr-23	5,82%	5,78%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	88.216	0,08%	IPCA		24-abr-23	5,81%	5,78%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	84.015	0,07%	IPCA		20-abr-23	5,80%	5,80%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	79.814	0,07%	IPCA		20-abr-23	5,81%	5,80%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	46.208	0,04%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	42.007	0,04%	IPCA		03-abr-23	5,92%	5,89%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	19.253	0,02%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	12.440	0,01%	IPCA		20-abr-23	5,81%	5,80%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	12.440	0,01%	IPCA		20-abr-23	5,80%	5,80%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	12.144	0,01%	IPCA		24-abr-23	5,81%	5,78%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	11.848	0,01%	IPCA		24-abr-23	5,82%	5,78%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	5.924	0,01%	IPCA		26-abr-23	5,78%	5,73%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	2.370	0,00%	IPCA		18-abr-23	5,70%	5,74%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	296	0,00%	IPCA		28-abr-23	5,78%	5,75%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	891	0,00%	IPCA		28-abr-23	3,93%	5,77%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	597	0,00%	IPCA		28-abr-23	5,81%	5,96%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	297	0,00%	IPCA		28-abr-23	5,86%	6,02%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	293	0,00%	IPCA		28-abr-23	6,44%	6,02%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	293	0,00%	IPCA		28-abr-23	3,55%	6,02%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	298	0,00%	IPCA		28-abr-23	6,33%	6,01%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	298	0,00%	IPCA		28-abr-23	4,47%	6,01%	ITAÚ GERI RF FI