

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.104.762,89</b>	<b>100%</b>			<b>0,88%</b>	<b>2,89%</b>	<b>6,32%</b>	<b>4,03%</b>				
Benchmark:	CDI				0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.104.762,89</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>								
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.186.372,80	81,99%	ITAÚ	0,01%	0,02%	0,90%	3,03%	6,44%	4,20%	13,46%	21,78%	24,15%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	918.390,09	17,99%	ITAÚ	0,03%	0,01%	0,88%	2,61%	6,29%	3,82%	14,12%	23,88%	27,65%
Benchmark:	CDI				0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
<b>Total</b>	<b>5.105.695,25</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>	<b>0,88%</b>	<b>2,89%</b>	<b>6,29%</b>	<b>4,03%</b>				
Benchmark:	CDI				0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	

\* 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.

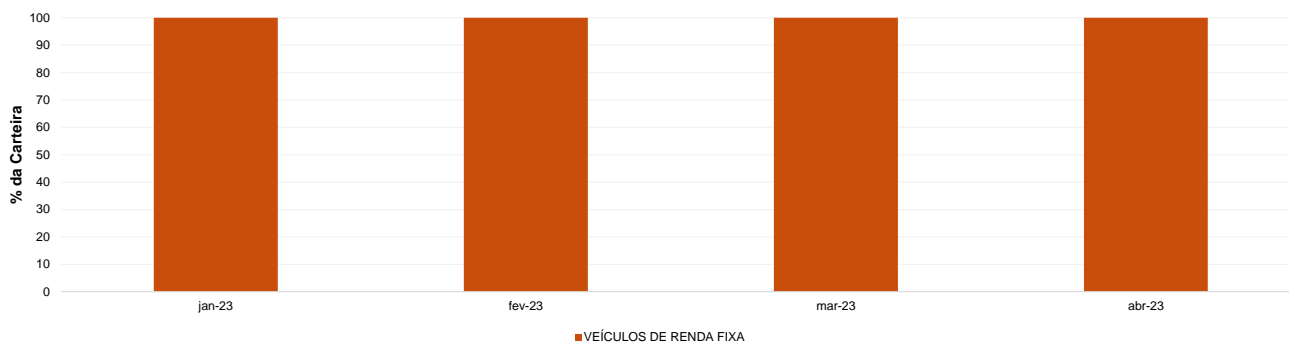
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

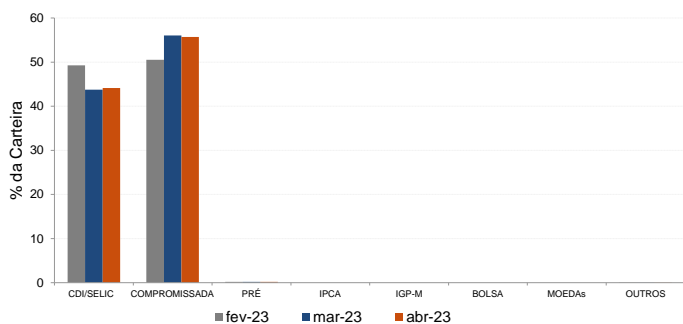
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

### Evolução do Patrimônio Líquido

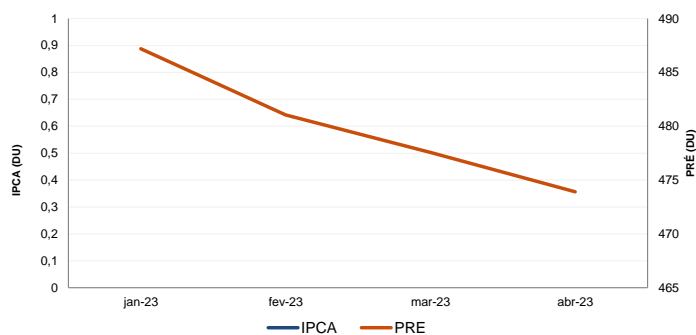


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 28/04/2023

## Análises de Contrapartes

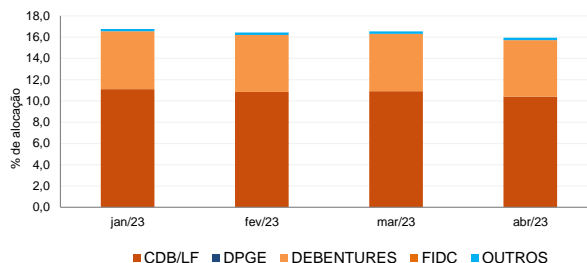
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	136,63	2,68	Faixa 1
BCO ITAU SA	81,23	1,59	Faixa 1
BCO SAFRA SA	66,64	1,31	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	43,72	0,86	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	30,14	0,59	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	30,03	0,59	Faixa 2
BANCO XP S.A	24,44	0,48	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	23,58	0,46	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	20,34	0,40	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	15,50	0,30	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	0,75	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-abr-28	CDI	2,40%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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
CSAN15	20-abr-28	754	0,01%	CDI	COSAN SA	28-abr-23	2,40%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-set-31	504	0,01%	CDI	BCO ITAU SA	26-abr-23	1,96%	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 2023-09-01	01-set-23	3.224	0,06%	Selic		04-abr-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.842	0,04%	Selic		03-abr-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.842	0,04%	Selic		03-abr-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.842	0,04%	Selic		03-abr-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.558	0,03%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.467	0,03%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.375	0,03%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	549	0,01%	Selic		24-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	457	0,01%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	184	0,00%	Selic		10-abr-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	182	0,00%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	36	0,00%	Selic		24-abr-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	27.014	0,53%	Selic		17-abr-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	9.005	0,18%	Selic		17-abr-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	91	0,00%	Selic		17-abr-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	10.762	0,21%	Selic		14-abr-23	0,11%	0,11%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI