

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/08/2023

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>5,339,931.68</b>	<b>100%</b>			<b>1.18%</b>	<b>3.40%</b>	<b>6.70%</b>	<b>8.80%</b>	<b>12.80%</b>			
Benchmark:	CDI				1.14%	3.32%	6.68%	8.87%	13.55%	25.14%	28.52%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5,339,931.68</b>	<b>100%</b>		<b>0.01%</b>								
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4,372,119.34	81.87%	ITAÚ	0.01%	0.02%	1.16%	3.36%	6.72%	8.94%	13.66%	25.48%	28.75%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	967,812.35	18.12%	ITAÚ	0.03%	0.00%	1.43%	4.05%	7.52%	9.41%	14.61%	28.33%	32.77%
Benchmark:	CDI				1.14%	3.32%	6.68%	8.87%	13.55%	25.14%	28.52%	
<b>Total</b>	<b>5,340,576.48</b>	<b>100%</b>		<b>0.01%</b>	<b>1.18%</b>	<b>3.40%</b>	<b>6.70%</b>	<b>8.80%</b>	<b>13.70%</b>			
Benchmark:	CDI				1.14%	3.32%	6.68%	8.87%	13.55%	25.14%	28.52%	

\* 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.

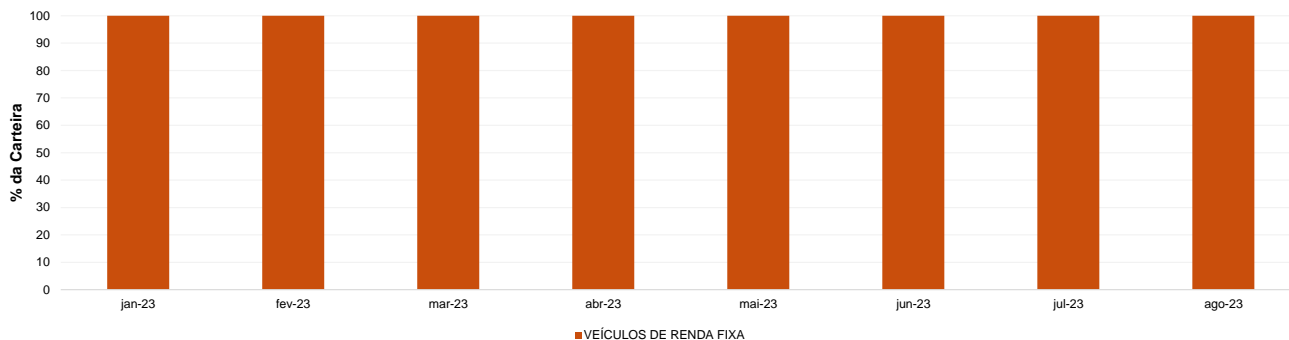
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

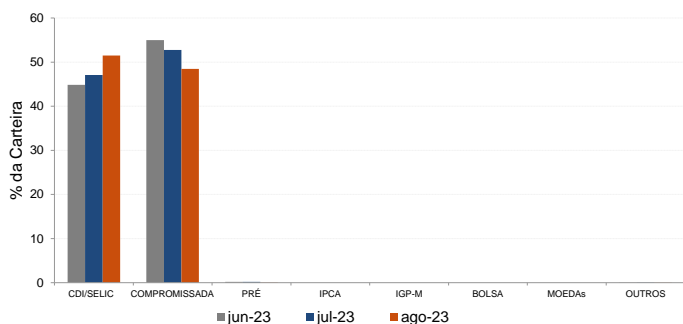
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais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

### Evolução do Patrimônio Líquido

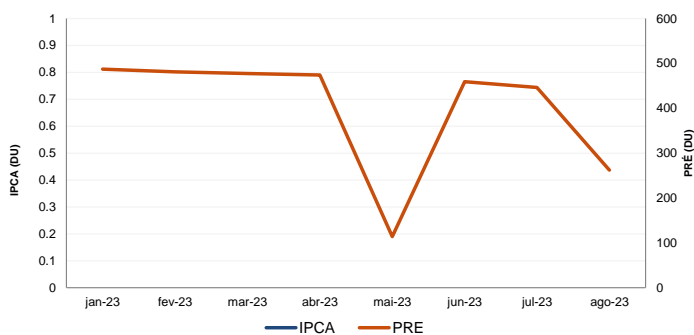


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

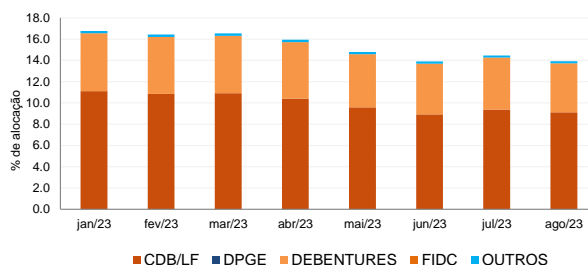
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	134.64	2.53	Faixa 1
BCO ITAU SA	75.13	1.41	Faixa 1
BCO SAFRA SA	70.73	1.33	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40.49	0.76	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	31.95	0.60	Faixa 2
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA P	22.59	0.42	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	22.53	0.42	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	19.84	0.37	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	15.93	0.30	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	15.44	0.29	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

**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
CDB CDI	29-jul-25	193	0.00%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	02-ago-23	1.20%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CEEBA6	15-ago-28	1,360	0.03%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	18-ago-23	1.95%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	03-set-25	2,650	0.05%	CDI	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	29-ago-23	1.05%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	10-set-25	2,665	0.05%	CDI	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	29-ago-23	1.05%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	31-jul-26	594	0.01%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	01-ago-23	1.20%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE Mensal	02-jan-26	1,943	0.04%	PRE	BCO TOYOTA BRASIL SA	10-ago-23	11.21%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE Mensal	01-jul-26	2,019	0.04%	PRE	BCO GMAC SA	09-ago-23	11.43%	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	119,686	2.25%	Selic	07-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	103,169	1.94%	Selic	15-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	47,874	0.90%	Selic	16-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	35,906	0.67%	Selic	14-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	35,906	0.67%	Selic	16-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	8,903	0.17%	Selic	07-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	6,728	0.13%	Selic	07-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	4,400	0.08%	Selic	03-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	2,394	0.04%	Selic	18-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	2,057	0.04%	Selic	11-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	527	0.01%	Selic	08-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	387	0.01%	Selic	11-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	132	0.00%	Selic	08-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	17	0.00%	Selic	08-ago-23	5.00%	0.05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	202	0.00%	Selic	08-ago-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	86	0.00%	Selic	25-ago-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	86	0.00%	Selic	30-ago-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	43	0.00%	Selic	08-ago-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	2,376	0.04%	Selic	07-ago-23	0.01%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	1,745	0.03%	Selic	25-ago-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	16,755	0.31%	Selic	07-ago-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1,197	0.02%	Selic	07-ago-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	175	0.00%	Selic	10-ago-23	0.11%	0.11%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	174	0.00%	Selic	29-ago-23	0.14%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-03-01	01-mar-29	27,887	0.52%	Selic	16-ago-23	0.16%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI