

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 29/12/2023

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
Renda Fixa	87.728.473,67	70,15%				1,15%	3,60%	6,63%	13,08%	13,08%		
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	64.365.361,04	51,47%										
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	64.365.361,04	51,47%		100%	0,56%	1,25%	3,86%	6,92%	12,97%	12,97%	-	-
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
RF CRÉDITO	16.137.149,36	12,90%										
PENSION FI RF CRED PRIV	4.359.479,07	3,49%	SAFRA	3,49%	0,01%	1,02%	3,41%	7,41%	14,31%	14,31%	31,77%	42,74%
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	2.851.329,25	2,28%	ARX	0,79%	0,04%	0,78%	2,78%	7,06%	11,26%	11,26%	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	978.211,08	0,78%	AUGME	0,46%	0,13%	0,85%	2,42%	6,42%	8,64%	8,64%	24,68%	35,55%
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	7.475.852,50	5,98%	CAPITANIA CAPITAL	5,69%	0,07%	0,90%	2,84%	6,38%	9,18%	9,18%	25,36%	-
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	472.277,46	0,38%	POLIGONO CAPITAL	0,05%	0,00%	1,02%	3,46%	7,19%	6,36%	6,36%	9,88%	18,84%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
RF	6.161.089,44	4,93%										
ITAÚ INSTIT. LUMINA PLUS RF LP FICFI	2.563.193,85	2,05%	ITAÚ	3,64%	0,57%	1,27%	2,61%	4,81%	-	-	-	-
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	3.597.895,59	2,88%	ITAÚ	0,18%	0,38%	1,18%	2,83%	5,44%	14,28%	14,28%	26,09%	32,96%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
MM FIC INSTITUCIONAL	577.582,48	0,46%										
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	577.582,48	0,46%	ITAÚ	1,35%	2,81%	1,32%	2,19%	5,09%	1,96%	1,96%	-17,52%	-
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
FIDC	487.291,34	0,39%										
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	64.909,58	0,05%	AVANTGARDE	0,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC B. E. C. C. STONE IV-SEN	404.198,98	0,32%	OLIVEIRA TRUST	0,00%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.182,79	0,01%	BNY MELLON	1,01%	1,17%	3,70%	8,07%	17,28%	17,28%	36,49%	44,34%	
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
Renda Variável	9.598.183,83	7,67%				5,62%	12,03%	8,35%	16,96%	16,96%		
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					5,63%	15,94%	15,31%	25,91%	25,91%	35,74%	23,13%
RV VALOR	5.443.858,28	4,35%										
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	1.648.751,38	1,32%	ABSOLUTO PARTNERS	0,45%	9,94%	6,08%	12,56%	3,24%	15,83%	15,83%	2,19%	-25,81%
GTI HAIFA FIA	817.168,29	0,65%	GTI ADM	0,35%	8,88%	8,68%	13,37%	8,20%	19,61%	19,61%	16,87%	27,00%
KIRON INSTIT. FIA	641.498,26	0,51%	KIRON CAPITAL	2,57%	9,24%	5,92%	9,51%	5,34%	9,82%	9,82%	16,82%	-5,58%
LIS VALUE FIA	867.181,78	0,69%	LIS CAPITAL	0,48%	12,66%	9,23%	17,04%	12,79%	16,72%	16,72%	0,63%	-2,65%
OCEANA SELECTION FIC FIA	1.469.258,58	1,17%	OCEANA	0,27%	7,00%	6,00%	14,44%	13,03%	28,67%	28,67%	33,86%	19,58%
Benchmark:	IBOVESPA					5,38%	15,12%	13,63%	22,28%	22,28%	28,01%	12,74%
RV ATIVO	2.965.653,02	2,37%										
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	603.332,07	0,48%	OCEANA	0,10%	6,09%	5,71%	15,32%	16,40%	27,38%	27,38%	39,54%	28,09%
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	1.555.947,48	1,24%	REAL INVESTOR	2,14%	5,63%	7,50%	15,70%	-	-	-	-	-
XP INVESTOR FIA	806.373,48	0,64%	XP	0,38%	5,91%	5,26%	13,78%	12,17%	26,25%	26,25%	40,23%	20,32%
Benchmark:	IBOVESPA					5,38%	15,12%	13,63%	22,28%	22,28%	28,01%	12,74%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	729.537,18	0,58%										
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	729.537,18	0,58%		100%	28,12%	5,52%	15,24%	14,21%	23,07%	23,07%	-	-
Benchmark:	IBX					5,48%	14,95%	13,77%	21,27%	21,27%	26,15%	12,05%
RV SMALL CAP	459.135,34	0,37%										
TARPON GT INSTIT. II FIC FIA	459.135,34	0,37%	TPE GESTORA	0,52%	7,11%	9,83%	11,56%	24,29%	56,24%	56,24%	-	-
Benchmark:	SMLL					7,05%	11,48%	3,40%	17,12%	17,12%	-0,52%	-16,63%
Estruturado	22.819.160,05	18,25%				3,01%	6,34%	4,69%	12,23%	12,23%		
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,13%	3,58%	7,72%	16,40%	16,40%	34,71%	44,83%
MM FIC	18.109.815,44	14,48%										
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	4.226.695,54	3,38%	ITAÚ	0,55%	2,21%	3,52%	5,96%	5,08%	9,55%	9,55%	30,18%	-
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	5.290.770,13	4,23%	ITAÚ	1,18%	5,95%	4,56%	12,80%	8,34%	31,17%	31,17%	40,94%	-
ITAÚ INSTIT. JANEIRO MULT FICFI	1.565.844,68	1,25%	ITAÚ	2,54%	0,19%	1,89%	5,19%	-	-	-	-	-
VIT MULT FIC FI MULT	7.026.505,08	5,62%	TAG INVEST	4,84%	2,06%	1,75%	3,13%	4,46%	7,37%	7,37%	21,24%	-
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
MM MACRO	4.709.344,61	3,77%										
ITAÚ ARTAX MULT FIC FI	1.585.330,45	1,27%	ITAÚ	0,26%	4,19%	3,26%	7,38%	6,68%	15,02%	15,02%	-	-
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIEMEN	2.346.508,77	1,88%	ITAÚ	1,55%	1,84%	2,77%	4,98%	6,83%	12,58%	12,58%	34,69%	-
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	777.505,39	0,62%	ITAÚ	1,91%	3,35%	3,61%	2,71%	0,65%	3,24%	3,24%	23,52%	24,73%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
Exterior	5.002.452,75	4,00%				1,88%	2,62%	5,25%	-1,20%	-1,20%		
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					2,81%	7,38%	7,31%	12,98%	12,98%	-14,93%	9,75%

* 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: 29/12/2023

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 INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.109.250,45	3,29%											
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.109.250,45	3,29%	TAG INVEST	15,83%	2,47%	2,14%	3,10%	6,73%	-0,08%	-0,08%	-17,03%	-	
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%	
RF INVESTIMENTO NO EXTERIOR	893.202,30	0,71%											
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	893.202,30	0,71%	ITAÚ	0,85%	3,35%	1,06%	0,74%	3,37%	-4,76%	-4,76%	-21,29%	-10,33%	
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%	
Total	125.063.834,50	100%			1,40%	1,85%	4,20%	6,47%	13,34%	13,34%	24,29%	26,08%	
Benchmark:	IPCA + 8.1% a.a.					1,18%	3,01%	5,71%	12,99%	12,99%	29,17%	53,63%	

* 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.

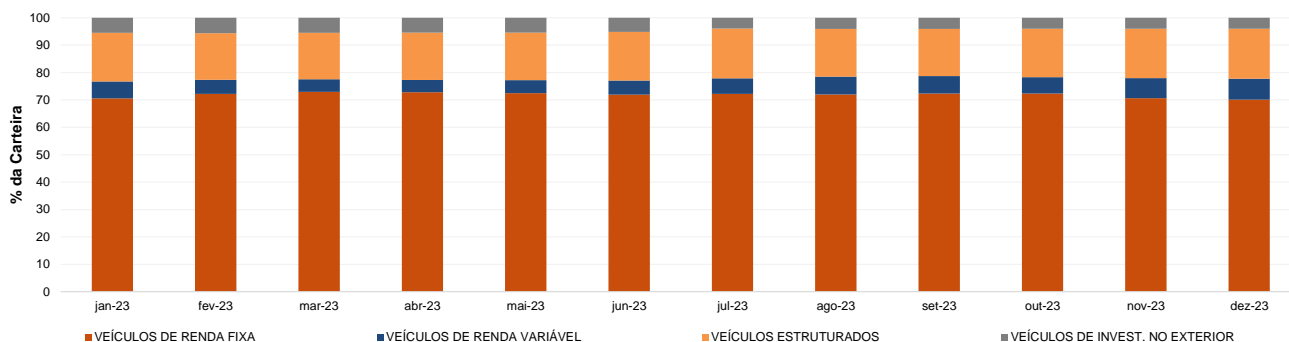


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

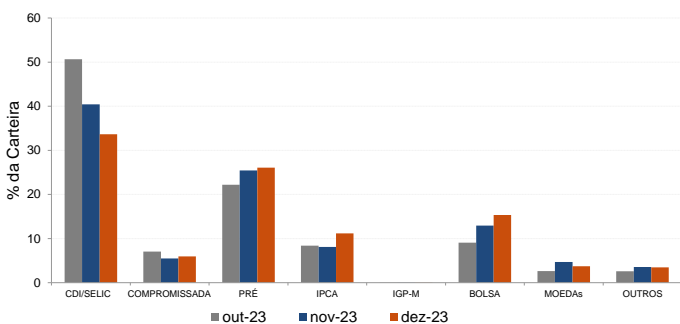
Distribuição da Carteira

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.

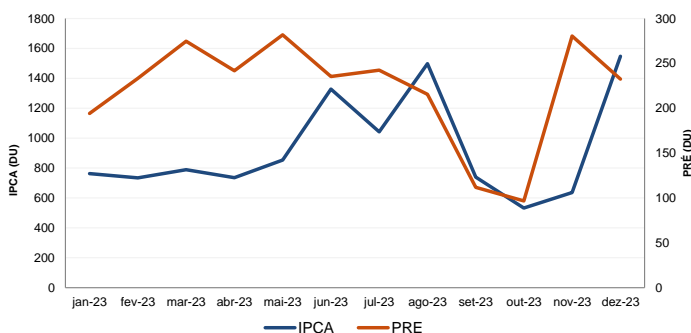
Evolução do Patrimônio Líquido



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		940,31	4,84	999,05	5,25
ELET3	Energia Elétrica	854,37	4,40	771,95	4,06
VALE3	Mineração	828,27	4,26	620,24	3,26
IGTI11	Exploração de Imóveis	763,25	3,93	741,44	3,90
ALOS3		639,83	3,29	545,44	2,87
EQTL3	Energia Elétrica	571,92	2,94	579,53	3,05
RENT3	Diversos	512,07	2,63	520,80	2,74
ENGI11	Energia Elétrica	470,20	2,42	599,57	3,15
SBSP3	Água e Saneamento	469,84	2,42	440,44	2,32
SHV US		418,24	2,15	224,13	1,18

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

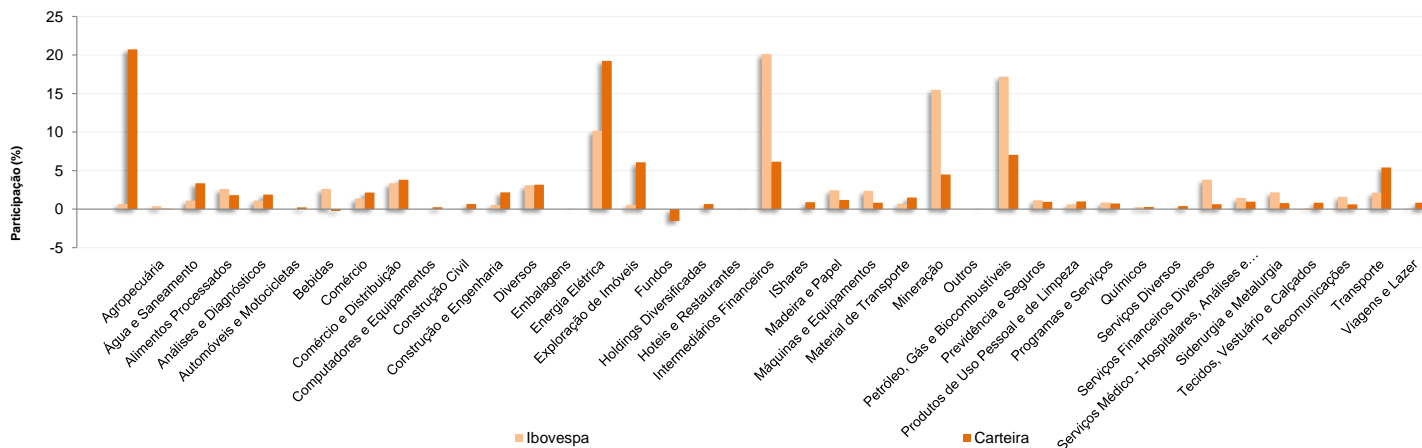
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ALSO3	6,18	0,03	0,00	Sem Liquidez
SULA11	0,87	0,00	0,00	Sem Liquidez
BRML3	0,34	0,00	0,00	Sem Liquidez
VIIA3	0,04	0,00	0,00	Sem Liquidez
ENBR3	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
SQIA3	-0,04	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	79,49	0,41	1,00	28
ELET3	854,37	4,40	0,00	1
VALE3	828,27	4,26	0,00	1
IGTI11	763,25	3,93	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.



RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 29/12/2023

Análises de Contrapartes

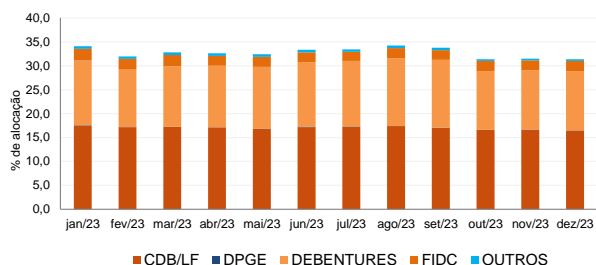
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.865,72	5,65	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.839,86	2,33	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.359,33	1,12	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.341,01	1,10	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.329,20	1,09	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	1.245,24	1,02	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	970,20	0,80	Faixa 1
VALE SA	828,63	0,68	Faixa 1
IGUATEMI S.A.	763,25	0,63	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	750,93	0,62	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
ENAT21	42,27	ENAUTA PARTICIPACOES S.A	Sem Faixa	Faixa 4	15-dez-27	CDI	4,42%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
OVSA10	5,81	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,42%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
OVSA10	40,02	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,57%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
OVSA10	39,96	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,55%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

