

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	5.547.865,67	100%			0,91%	2,89%	6,27%	13,05%	13,05%			
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%	
Renda Fixa	5.547.865,67	100%		0,01%								
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	3.600.247,33	64,89%	ITAÚ	0,01%	0,90%	2,83%	6,17%	13,13%	13,13%	27,29%	33,01%	
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	1.947.618,34	35,10%	ITAÚ	0,06%	0,98%	3,30%	7,35%	14,30%	14,30%	30,29%	37,71%	
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%	
Total	5.548.637,82	100%		0,01%	0,91%	2,89%	6,27%	13,05%	13,05%			
Benchmark:	CDI				0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%	

* 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.

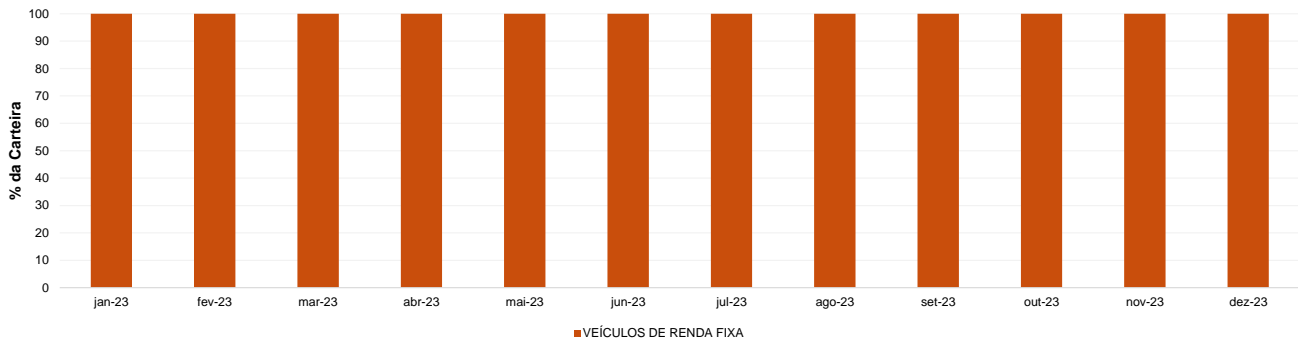
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

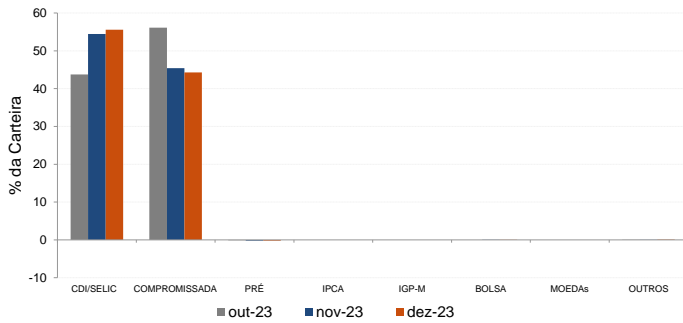
Distribuição da Carteira

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.

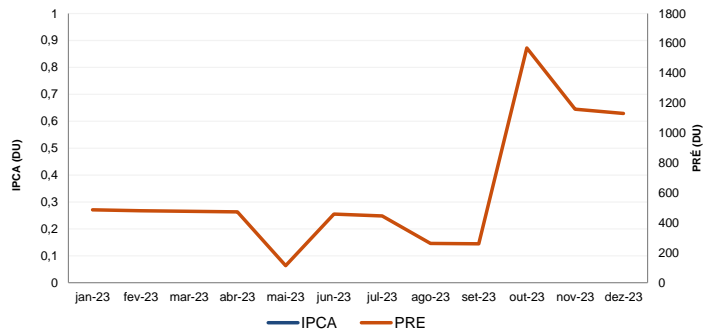
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 29/12/2023

Análises de Contrapartes

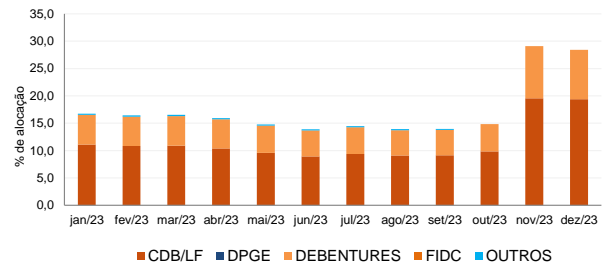
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	281,31	5,11	Faixa 1
BCO ITAU SA	156,63	2,85	Faixa 1
BCO SAFRA SA	134,52	2,44	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	87,27	1,59	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	77,55	1,41	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	51,73	0,94	Faixa 1
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETTRICA P	46,37	0,84	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	43,43	0,79	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	43,39	0,79	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	33,82	0,61	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.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 29/12/2023

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
EUFA15	15-nov-27	317	0,01%	CDI	EUROFARMA LABORATÓRIOS S/A	04-dez-23	1,25%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-dez-25	2.247	0,04%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-dez-26	1.670	0,03%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,10%	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 2024-03-01	01-mar-24	29.628	0,54%	Selic		18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	29.616	0,54%	Selic		19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.267	0,10%	Selic		18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.264	0,10%	Selic		19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	13.128	0,24%	Selic		28-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.320	0,02%	Selic		11-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	989	0,02%	Selic		11-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	926	0,02%	Selic		01-dez-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	65	0,00%	Selic		14-dez-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	15.410	0,28%	Selic		07-dez-23	0,08%	0,08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	14.729	0,27%	Selic		14-dez-23	0,12%	0,12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	93	0,00%	Selic		05-dez-23	0,12%	0,12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	16.524	0,30%	Selic		06-dez-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	14.901	0,27%	Selic		14-dez-23	0,13%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	4.657	0,08%	Selic		05-dez-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-09-01	01-set-28	465	0,01%	Selic		05-dez-23	0,16%	0,16%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	7.416	0,13%	Selic		07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI