

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV 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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	232.205.629,31	83,83%				1,08%	3,40%	6,48%	13,34%	13,34%		
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	167.500.350,15	60,47%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF RAI	167.500.350,15	60,47%		100%	0,36%	1,14%	3,58%	6,61%	13,83%	13,83%	-	-
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
RF CRÉDITO	41.395.329,53	14,94%										
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	1.947.618,34	0,70%	ITAÚ	0,06%	0,02%	0,98%	3,30%	7,35%	14,30%	14,30%	30,29%	37,71%
PENSION FI RF CRED PRIV	8.991.349,73	3,25%	SAFRA	7,20%	0,01%	1,02%	3,41%	7,41%	14,31%	14,31%	31,77%	42,74%
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	6.381.084,37	2,30%	ARX	1,77%	0,04%	0,78%	2,78%	7,06%	11,26%	11,26%	-	-
AUGME ESTRATEGICO II FI MULT CRED PRIV	848.000,74	0,31%	AUGME	1,03%	0,03%	1,02%	3,46%	8,12%	-	-	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	1.633.269,78	0,59%	AUGME	0,77%	0,13%	0,85%	2,42%	6,42%	8,64%	8,64%	24,68%	35,55%
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	16.332.800,36	5,90%	CAPITANIA CAPITAL	12,43%	0,07%	0,90%	2,84%	6,38%	9,18%	9,18%	25,36%	-
VALORA TITAN TI FIC FI MULT CRED PRIV	4.161.108,78	1,50%	TAG INVEST	1,18%	0,45%	1,09%	2,98%	6,79%	14,67%	14,67%	32,09%	42,45%
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	1.100.097,42	0,40%	POLIGONO CAPITAL	0,12%	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	17.415.908,14	6,29%										
ITAÚ INSTIT. LUMINA PLUS RF LP FICFI	7.053.437,56	2,55%	ITAÚ	10,03%	0,57%	1,27%	2,61%	4,81%	-	-	-	-
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	10.362.470,58	3,74%	ITAÚ	0,52%	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%
RF REFERENCIADO DI	4.461.271,74	1,61%										
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	861.024,40	0,31%	BRADESCO	0,03%	0,01%	0,90%	2,81%	6,14%	13,05%	13,05%	27,14%	32,84%
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	3.600.247,33	1,30%	ITAÚ	0,01%	0,01%	0,90%	2,83%	6,17%	13,13%	13,13%	27,29%	33,01%
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
FIDC	855.187,28	0,31%										
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	39.527,80	0,01%	BNY MELLON	2,20%		1,17%	3,70%	8,07%	17,28%	17,28%	36,49%	44,34%
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	123.318,64	0,04%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
FIDC B. E. C. C. STONE IV-SEN	692.340,84	0,25%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,90%	2,84%	6,15%	13,05%	13,05%	27,03%	32,62%
MM FIC INSTITUCIONAL	577.582,48	0,21%										
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	577.582,48	0,21%	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%
Renda Variável	9.598.183,83	3,47%				5,62%	12,04%	8,36%	16,95%	16,95%		
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	1,97%										
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	1.648.751,38	0,60%	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	0,30%	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	0,23%	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	0,31%	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	0,53%	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	1,07%										
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	603.332,07	0,22%	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	0,56%	REAL INVESTOR	2,14%	5,63%	7,50%	15,70%	-	-	-	-	-
XP INVESTOR FIA	806.373,48	0,29%	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	0,26%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RV RAI	729.537,18	0,26%		100%	39,10%	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	0,17%										
TARPON GT INSTIT. II FIC FIA	459.135,34	0,17%	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	30.362.506,38	10,96%				3,03%	6,26%	4,71%	11,18%	11,18%		
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,13%	3,58%	7,72%	16,40%	16,40%	34,71%	44,83%
MM FIC	21.461.833,60	7,75%										
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	6.454.373,54	2,33%	ITAÚ	0,83%	2,21%	3,52%	5,96%	5,08%	9,55%	9,55%	30,18%	-
ITAÚ INSTIT. JANEIRO MULT FICFI	2.690.184,85	0,97%	ITAÚ	4,37%	0,19%	1,89%	5,19%	-	-	-	-	-
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	5.290.770,13	1,91%	ITAÚ	1,18%	5,95%	4,56%	12,80%	8,34%	31,17%	31,17%	40,94%	-
VIT MULT FIC FI MULT	7.026.505,08	2,54%	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%

* 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 PLANO CV 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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
MM MACRO	8.900.672,78	3,21%											
ITAÚ ARTAX MULT FIC FI	4.373.329,28	1,58%	ITAÚ	0,71%	4,19%	3,26%	7,38%	6,68%	15,02%	15,02%	-	-	
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIIMEN	3.181.371,52	1,15%	ITAÚ	2,11%	1,84%	2,77%	4,98%	6,83%	12,58%	12,58%	34,69%	-	
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	1.345.971,98	0,49%	ITAÚ	3,30%	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	1,81%				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%	
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.109.250,45	1,48%											
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.109.250,45	1,48%	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	0,32%											
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	893.202,30	0,32%	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	277.000.627,82	100%				0,77%	1,43%	3,57%	6,19%	12,87%	12,87%	25,91%	29,67%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,90%	2,14%	3,89%	9,16%	9,16%	20,52%	38,45%	

* 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.

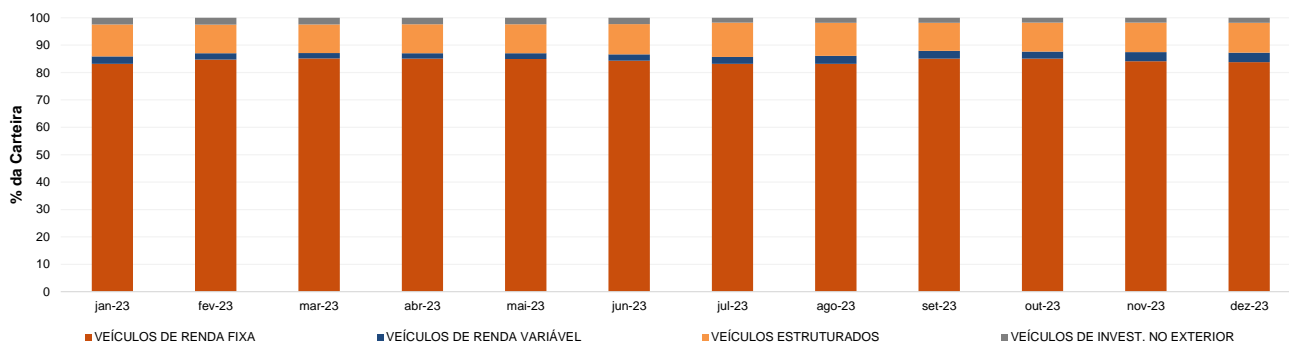
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

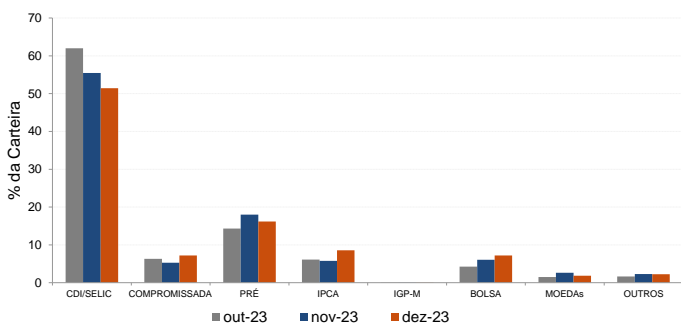
Distribuição da Carteira

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.

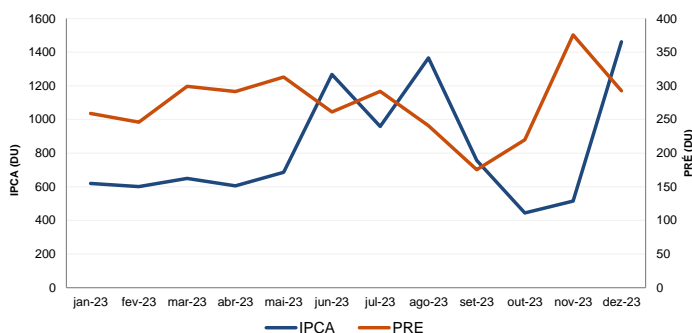
Evolução do Patrimônio Líquido



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 a qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
ELET3	Energia Elétrica	941,83	4,60	855,55	4,27
IDTP LN		940,31	4,59	999,05	4,99
VALE3	Mineração	874,30	4,27	659,23	3,29
IGTI11	Exploração de Imóveis	780,92	3,81	755,12	3,77
ALOS3		648,13	3,16	554,41	2,77
EQTL3	Energia Elétrica	613,81	3,00	622,20	3,11
ENGI11	Energia Elétrica	531,28	2,59	658,94	3,29
RENT3	Diversos	518,29	2,53	527,56	2,63
RBSP3	Água e Saneamento	474,91	2,32	444,98	2,22
ITUB4	Intermediários Financeiros	459,74	2,24	463,05	2,31

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

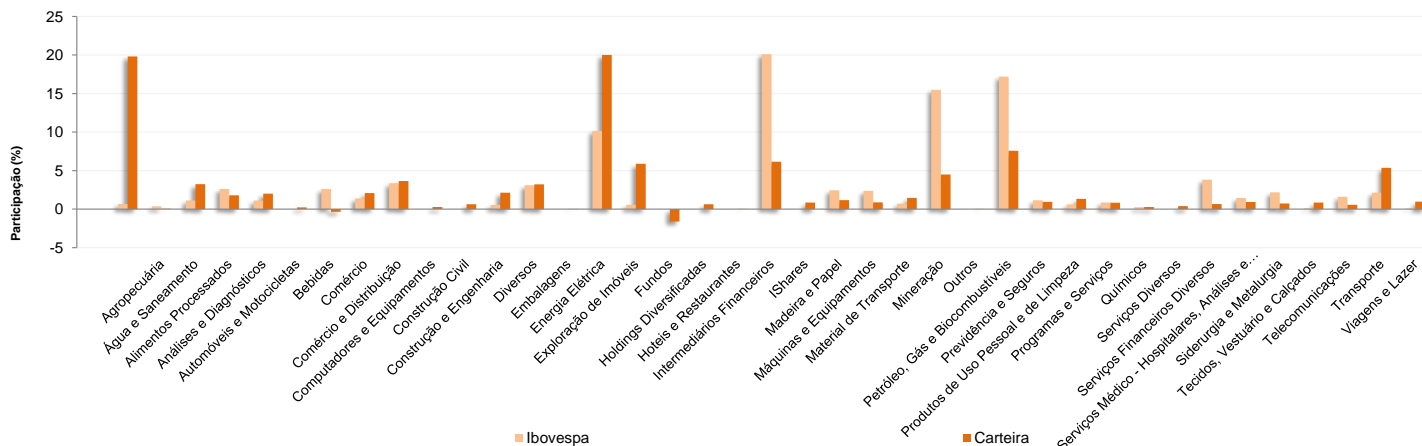
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ALSO3	9,40	0,05	0,00	Sem Liquidez
SULA11	0,87	0,00	0,00	Sem Liquidez
BRML3	0,34	0,00	0,00	Sem Liquidez
VIIA3	0,07	0,00	0,00	Sem Liquidez
ENBR3	0,04	0,00	0,00	Sem Liquidez
SQIA3	-0,06	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	79,49	0,39	1,00	28
ELET3	941,83	4,60	0,00	1
VALE3	874,30	4,27	0,00	1
IGTI11	780,92	3,81	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

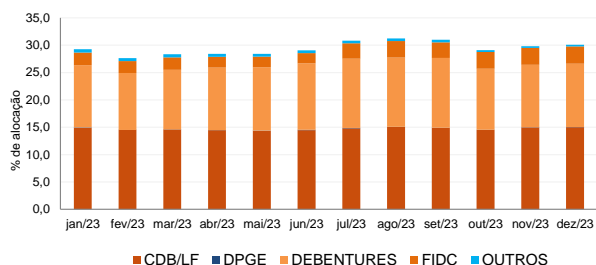
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.723,93	4,32	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.978,35	1,84	Faixa 1
BCO ITAU SA	3.792,37	1,40	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.845,84	1,05	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	2.034,84	0,75	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	1.641,47	0,61	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.531,87	0,56	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.482,33	0,55	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	1.467,08	0,54	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	1.250,77	0,46	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	92,35	ENAUTA PARTICIPACOES S.A	Sem Faixa	Faixa 4	15-dez-27	CDI	4,42%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
OVSA10	12,99	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,42%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
OVSA10	87,44	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,57%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
OVSA10	87,31	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	Faixa 3	Faixa 2	20-jun-26	CDI	2,55%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

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
CASN13	16-nov-28	10.479	0,00%	CDI	CIA CATARINENSE AGUAS SANEAMENTC	07-dez-23	5,52%	Faixa 5	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CEEBA7	15-nov-28	84.978	0,03%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	21-dez-23	1,28%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
CEPEA3	15-nov-28	75.418	0,03%	CDI	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	21-dez-23	1,28%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
CRI PVSC 45 1	25-ago-38	14.500	0,01%	IPCA	COMPANHIA PROVINCIA DE SECURITIZAI	13-dez-23	9,53%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
EGIED1	15-nov-28	378.560	0,14%	CDI	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	07-dez-23	1,00%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
EUFA15	15-nov-27	182.482	0,07%	CDI	EUROFARMA LABORATÓRIOS S/A	04-dez-23	1,28%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
EUFA15	15-nov-27	317	0,00%	CDI	EUROFARMA LABORATÓRIOS S/A	04-dez-23	1,25%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
HARG11	15-out-36	163.272	0,06%	IPCA	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	20-dez-23	6,24%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
IPIL11	15-dez-35	107.305	0,04%	IPCA	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO	20-dez-23	6,73%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LF CDI	01-dez-25	2.247	0,00%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-dez-25	50.334	0,02%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	08-dez-23	0,85%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
LF CDI	01-dez-26	1.670	0,00%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,10%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Mensal	01-dez-25	50.463	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,00%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
LF CDI Mensal	01-dez-25	50.463	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,00%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
LF CDI Mensal	01-dez-26	50.467	0,02%	CDI	BANCO XP S.A	01-dez-23	1,10%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
LF CDI Mensal	10-dez-26	50.095	0,02%	CDI	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	22-dez-23	0,95%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
ONCO19	25-nov-27	48.642	0,02%	CDI	ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDI	20-dez-23	5,55%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
OUSA10	20-jun-26	87.311	0,03%	CDI	UNIDAS LOCACOES E SERVICOS S/A	20-dez-23	2,55%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
POSI13	07-fev-26	48.644	0,02%	CDI	POSITIVO TECNOLOGIA SA	20-dez-23	3,06%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RAHD11	15-out-40	62.629	0,02%	IPCA	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	20-dez-23	8,15%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RDORC9	20-ago-31	48.715	0,02%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	20-dez-23	1,91%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RSAN24	15-fev-26	87.206	0,03%	CDI	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO COR:	20-dez-23	1,89%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RSAN25	05-dez-28	18.256	0,01%	CDI	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO COR:	06-dez-23	2,91%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
TCII11	15-set-41	116.606	0,04%	IPCA	AES TUCANO HOLDING II S.A	20-dez-23	22,23%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
UNIP18	16-out-30	4.442	0,00%	CDI	UNIPAR CARBOCLORO SA	01-dez-23	2,05%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
VLME11	15-nov-27	9.355	0,00%	CDI	VRENTAL LOCAÇÃO DE MÁQUINAS E EQI	14-dez-23	4,24%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
VLME11	15-nov-27	3.896	0,00%	CDI	VRENTAL LOCAÇÃO DE MÁQUINAS E EQI	14-dez-23	4,24%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
VLME11	15-nov-27	2.341	0,00%	CDI	VRENTAL LOCAÇÃO DE MÁQUINAS E EQI	14-dez-23	4,24%	Sem Faixa	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV

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	0,01%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	29.616	0,01%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.267	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.264	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.130	0,00%	Selic	08-dez-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	405	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	405	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	114	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	114	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	72	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	72	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	58	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	58	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	49	0,00%	Selic	07-dez-23	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	20	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	20	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	15	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	15	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	10	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	10	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	10	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	10	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	6	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	18-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	0	0,00%	Selic	19-dez-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI

Ess
e
doc
ume
nto
é
prop
ried
ade
da
ADI
TUS
Con
sulto
ria
Fina
ncei
ra e
sua
repr
odú
ção
requ
er
auto
rizaç
ão
expr
essa
da
mes
ma.
Os
dad
os
aqui
apre
sent
ado
s
fora
m
obli
ga



Ess
e
doc
ume
nto
é
prop
ried
ade
da
ADI
TUS
Con
sulto
ria
Fina
ncei
ra e
sua
repr
odú
ção
requ
er
auto
rizaç
ão
expr
essa
da
mes
ma.
Os
dad
os
aqui
apre
sent
ado
s
fora
m
obli
ga

Ess
e
doc
ume
nto
é
prop
ried
ade
da
ADI
TUS
Con
sulto
ria
Fina
ncei
ra e
sua
repr
odú
ção
requ
er
auto
rizaç
ão
expr
essa
da
mes
ma.
Os
dad
os
aqui
apre
sent
ado
s
fora
m
obli
ga



Ess
e
doc
ume
nto
é
prop
ried
ade
da
ADI
TUS
Con
sulto
ria
Fina
ncei
ra e
sua
repr
odú
ção
requ
er
auto
rizaç
ão
expr
essa
da
mes
ma.
Os
dad
os
aqui
apre
sent
ado
s
fora
m
obli
ga



RBSPREV - RBSPREV PLANO CV RAI

Data-base: 29/12/2023

Titulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	0	0,00%	Selic	07-dez-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	115.004	0,04%	IPCA	06-dez-23	6,78%	6,86%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	106.485	0,04%	IPCA	06-dez-23	6,78%	6,86%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	118.797	0,04%	IPCA	06-dez-23	5,87%	5,88%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	106.069	0,04%	IPCA	06-dez-23	5,87%	5,88%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	100.573	0,04%	IPCA	15-dez-23	5,70%	5,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	51.291	0,02%	IPCA	15-dez-23	5,69%	5,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	98.235	0,04%	IPCA	15-dez-23	5,30%	5,25%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	13.710	0,01%	IPCA	19-dez-23	5,21%	5,18%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	13.063	0,00%	IPCA	06-dez-23	5,53%	5,51%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	8.617	0,00%	IPCA	06-dez-23	5,58%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	4.308	0,00%	IPCA	06-dez-23	5,58%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	1.366.291	0,50%	IPCA	28-dez-23	5,24%	5,22%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	348.184	0,13%	IPCA	28-dez-23	5,24%	5,22%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	268.851	0,10%	IPCA	06-dez-23	5,55%	5,52%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	189.518	0,07%	IPCA	06-dez-23	5,55%	5,52%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	158.666	0,06%	IPCA	06-dez-23	5,56%	5,52%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	114.592	0,04%	IPCA	06-dez-23	5,56%	5,52%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	72.068	0,03%	IPCA	18-dez-23	5,46%	0,00%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	71.884	0,03%	IPCA	18-dez-23	5,48%	0,00%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	307.883	0,11%	IPCA	22-dez-23	5,53%	5,49%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	183.810	0,07%	IPCA	06-dez-23	5,76%	5,74%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	165.429	0,06%	IPCA	22-dez-23	5,53%	5,49%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	101.096	0,04%	IPCA	06-dez-23	5,76%	5,74%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	18.381	0,01%	IPCA	06-dez-23	5,76%	5,74%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	241.516	0,09%	IPCA	27-dez-23	5,51%	5,49%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	3.321.888	1,22%	IPCA	04-dez-23	5,73%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	1.684.077	0,62%	IPCA	04-dez-23	5,73%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	323.861	0,12%	IPCA	28-dez-23	5,49%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR

Ess
e
doc
ume
nto
é
prop
ried
ade
da
ADI
TUS
Con
sulto
ria
Fina
ncei
ra e
sua
repr
odú
ção
requ
er
auto
rizaç
ão
expr
essa
da
mes
ma.
Os
dad
os
aqui
apre
sent
ado
s
fora
m
obli
ga

