

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/07/2023

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.275.769,43</b>	<b>100%</b>			<b>1,08%</b>	<b>3,37%</b>	<b>6,35%</b>	<b>7,53%</b>				
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.275.769,43</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>								
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.321.640,60	81,90%	ITAÚ	0,01%	0,02%	1,07%	3,35%	6,49%	7,69%	13,68%	24,58%	27,48%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	954.128,82	18,08%	ITAÚ	0,03%	0,01%	1,30%	3,89%	6,60%	7,86%	14,48%	27,17%	31,23%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%	
<b>Total</b>	<b>5.276.543,53</b>	<b>100%</b>		<b>0,02%</b>	<b>1,08%</b>	<b>3,37%</b>	<b>6,35%</b>	<b>7,53%</b>				
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%	

\* 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.

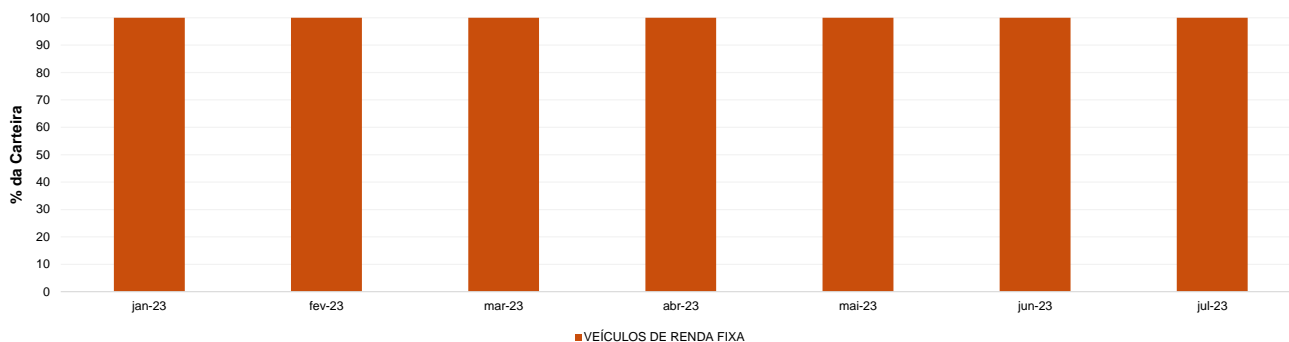
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

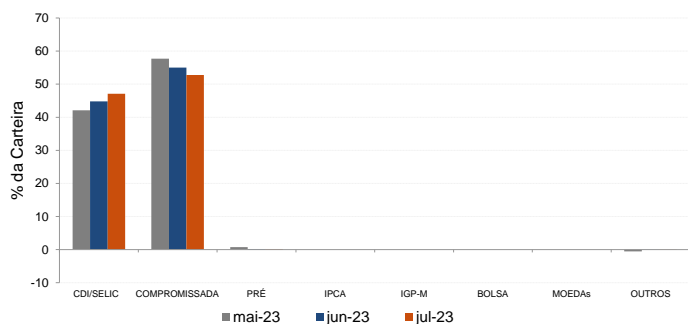
## Distribuição da Carteira

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.

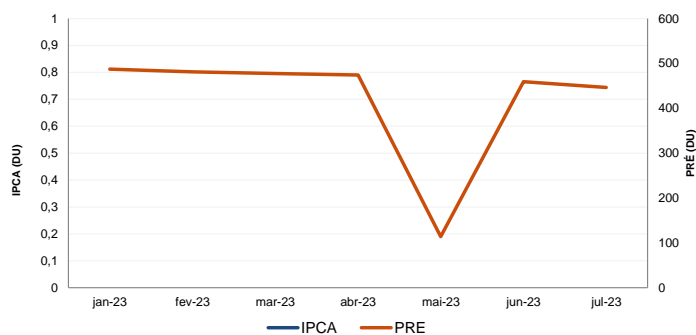
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

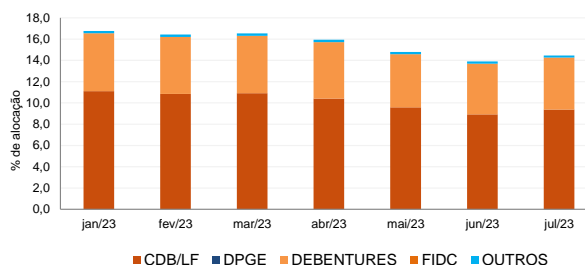
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	133,41	2,53	Faixa 1
BCO ITAU SA	74,48	1,41	Faixa 1
BCO SAFRA SA	70,11	1,33	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,12	0,76	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	31,67	0,60	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	23,10	0,44	Faixa 2
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA P	22,68	0,43	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	22,38	0,42	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	19,65	0,37	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	17,08	0,32	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/07/2023

## 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
CDB CDI	29-jul-25	869	0,02%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	28-jul-23	1,20%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
EQTL15	15-dez-26	47	0,00%	CDI	EQUATORIAL ENERGIA SA	19-jul-23	1,89%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-jan-24	573	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	14-jul-23	0,75%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-fev-24	6.178	0,12%	CDI	BCO SAFRA SA	18-jul-23	0,74%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	13-mai-24	1.355	0,03%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	18-jul-23	0,94%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	13-mai-24	275	0,01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	14-jul-23	0,94%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-jun-24	1.355	0,03%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	18-jul-23	0,96%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-jun-24	915	0,02%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	18-jul-23	0,96%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-jun-24	256	0,00%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	14-jul-23	0,96%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-ago-24	683	0,01%	CDI	BCO SAFRA SA	19-jul-23	0,81%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	16-set-24	986	0,02%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	18-jul-23	1,02%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	04-nov-24	0	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	18-jul-23	0,83%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	24-mar-25	416	0,01%	CDI	BCO SAFRA SA	14-jul-23	0,93%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-abr-25	1.184	0,02%	CDI	BCO SAFRA SA	14-jul-23	0,94%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-jun-25	901	0,02%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	0,86%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	21-jul-25	341	0,01%	CDI	BCO SAFRA SA	14-jul-23	0,98%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	11-ago-25	183	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	14-jul-23	0,99%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-set-25	1.078	0,02%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	18-jul-23	1,41%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	27-jul-26	1.346	0,03%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	25-jul-23	1,42%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-jul-26	2.431	0,05%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-jul-23	1,20%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-jul-27	4.342	0,08%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	25-jul-23	1,60%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	17-set-27	4.053	0,08%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	1,11%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	17-set-27	1.036	0,02%	CDI	BCO BRADESCO SA	14-jul-23	1,11%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	27-nov-30	430	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	2,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	27-nov-30	108	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	2,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	04-ago-31	1.294	0,02%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	2,31%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	04-ago-31	588	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	2,31%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-dez-32	1.875	0,04%	CDI	BCO BRADESCO SA	18-jul-23	1,92%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-dez-32	592	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	12-jul-23	1,92%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	12-abr-50	1.115	0,02%	CDI	BCO BRADESCO SA	19-jul-23	3,58%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE Mensal	01-jul-26	2.077	0,04%	PRE	BCO TOYOTA BRASIL SA	18-jul-23	11,82%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
MOV17	15-set-26	279	0,01%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	19-jul-23	3,23%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SBSPD9	15-dez-26	62	0,00%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	19-jul-23	1,40%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
TRPLA3	15-mar-30	9.827	0,19%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	18-jul-23	1,49%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
VBRR14	16-nov-28	32	0,00%	CDI	VIBRA ENERGIA SA	19-jul-23	1,79%	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	71.565	1,36%	Selic	13-jul-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	3.581	0,07%	Selic	11-jul-23	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.339	0,03%	Selic	19-jul-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	537	0,01%	Selic	10-jul-23	0,03%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	446	0,01%	Selic	21-jul-23	5,00%	0,05%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	179	0,00%	Selic	10-jul-23	0,03%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	134	0,00%	Selic	11-jul-23	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	134	0,00%	Selic	11-jul-23	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	134	0,00%	Selic	11-jul-23	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.372	0,10%	Selic	11-jul-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.350	0,10%	Selic	21-jul-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	4.967	0,09%	Selic	06-jul-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	62	0,00%	Selic	10-jul-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	27	0,00%	Selic	11-jul-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	45	0,00%	Selic	10-jul-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	13.376	0,25%	Selic	24-jul-23	0,15%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	1.022	0,02%	Selic	10-jul-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	891	0,02%	Selic	24-jul-23	0,15%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	808	0,02%	Selic	03-jul-23	0,13%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	448	0,01%	Selic	06-jul-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	89	0,00%	Selic	06-jul-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	89	0,00%	Selic	24-jul-23	0,15%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	449	0,01%	Selic	03-jul-23	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI