

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/06/2023

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 | 125,297,676.54 | 93.71% | | | | 1.22% | 3.02% | 6.26% | 6.26% | | | | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 85,595,646.20 | 64.02% | | | | | | | | | | | |
| RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF | 85,595,646.20 | 64.02% | | 100% | 0.07% | 1.23% | 2.87% | 6.59% | 6.59% | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| RF CRÉDITO | 20,337,079.90 | 15.21% | | | | | | | | | | | |
| PENSION FI RF CRED PRIV | 7,512,966.88 | 5.62% | SAFRA | 8.12% | 0.00% | 1.19% | 3.33% | 6.43% | 6.43% | 14.61% | 29.49% | - | |
| ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV | 3,297,112.75 | 2.47% | ARX | 1.52% | 0.03% | 1.07% | 3.09% | 3.93% | 3.93% | - | - | - | |
| AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV | 615,563.03 | 0.46% | AUGME | 0.31% | 0.17% | 1.27% | 3.25% | 2.09% | 2.09% | 9.66% | 23.41% | 32.28% | |
| CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF | 8,325,745.69 | 6.23% | CAPITANIA CAPITAL | 8.49% | 0.09% | 1.15% | 2.95% | 2.64% | 2.64% | 10.07% | 23.18% | - | |
| ORION FIC FI MULT - CRED PRIV | 585,691.55 | 0.44% | CAPTALYS | 0.07% | 0.00% | 1.09% | 3.43% | -0.78% | -0.78% | -3.64% | 6.97% | 16.63% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| RF REFERENCIADO DI | 10,498,703.91 | 7.85% | | | | | | | | | | | |
| BRDESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA | 10,498,703.91 | 7.85% | BRDESCO | 0.10% | 0.03% | 1.07% | 3.09% | 6.38% | 6.38% | 13.28% | 22.89% | 25.21% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| RF | 8,492,029.76 | 6.35% | | | | | | | | | | | |
| ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI | 8,492,029.76 | 6.35% | ITAU | 0.49% | 0.46% | 1.66% | 4.39% | 8.38% | 8.38% | 13.14% | 23.94% | 27.95% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| FIDC | 374,216.77 | 0.28% | | | | | | | | | | | |
| FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7 | 21,729.72 | 0.02% | BNY MELLON | 0.00% | | 1.40% | 4.11% | 8.53% | 8.53% | 17.95% | 31.39% | 35.28% | |
| FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR | 64,162.63 | 0.05% | AVANTGARDE | 0.00% | | - | - | - | - | - | - | - | |
| FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO | 288,324.42 | 0.22% | OLIVEIRA TRUST | 0.00% | | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| Estruturado | 8,455,822.74 | 6.32% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | CDI + 3% a.a. | | | | | 1.32% | 3.89% | 8.06% | 8.06% | 16.94% | 30.87% | 37.84% | |
| MM FIC | 5,123,907.67 | 3.83% | | | | | | | | | | | |
| ITAU GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI | 5,123,907.67 | 3.83% | ITAU | 1.08% | 1.18% | 1.97% | 3.51% | 4.25% | 4.25% | 10.98% | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| MM MACRO | 3,331,915.08 | 2.49% | | | | | | | | | | | |
| ITAU INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIMEN | 781,495.35 | 0.58% | ITAU | 0.45% | 1.41% | 1.66% | 2.82% | 5.38% | 5.38% | 13.82% | 38.97% | - | |
| ITAU INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI | 2,550,419.72 | 1.91% | ITAU | 0.83% | 1.97% | 0.90% | 0.24% | 2.58% | 2.58% | 8.33% | 23.25% | 29.61% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1.07% | 3.15% | 6.50% | 6.50% | 13.54% | 23.37% | 26.17% | |
| Total | 133,704,587.55 | 100% | | | | 0.13% | 1.25% | 3.10% | 6.09% | 6.09% | 13.20% | 23.46% | 28.40% |
| Benchmark: | IPCA + 7.2% a.a. | | | | | 0.50% | 2.47% | 6.45% | 6.45% | 10.56% | 32.61% | 53.98% | |

* 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.

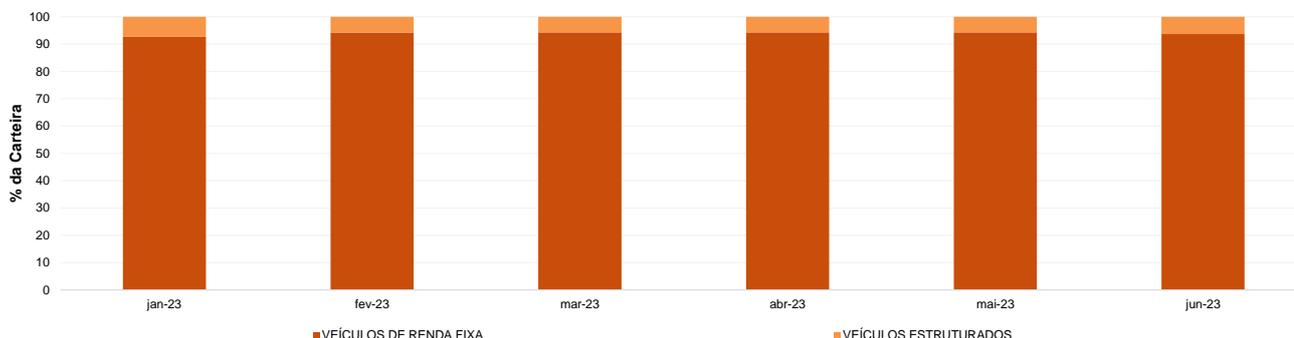
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

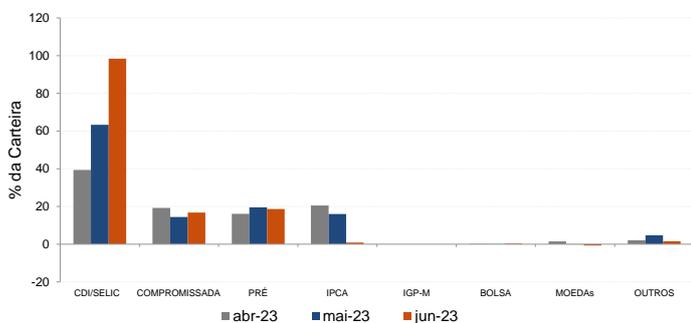
Distribuição da Carteira

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.

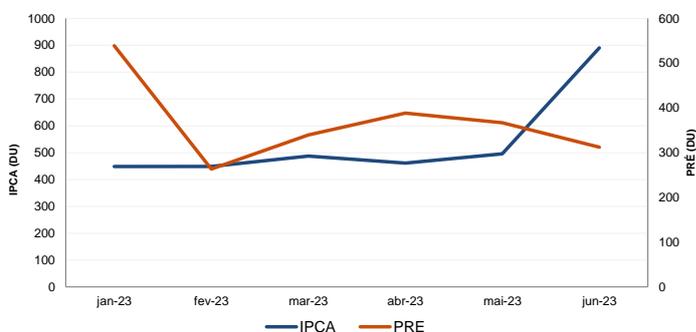
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de 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* | % |
|--------|---------------------------------|--------|-------|-----------|------|
| VALE3 | Mineração | 112.60 | 10.54 | 69.78 | 9.45 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 83.18 | 7.79 | 7.32 | 0.99 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 80.69 | 7.55 | 47.67 | 6.46 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 79.38 | 7.43 | 48.12 | 6.52 |
| PRI03 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 75.26 | 7.05 | 58.40 | 7.91 |
| RENT3 | Diversos | 70.59 | 6.61 | 3.32 | 0.45 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 53.91 | 5.05 | 36.81 | 4.99 |
| RAIL3 | Transporte | 50.16 | 4.70 | 24.74 | 3.35 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 49.68 | 4.65 | 10.29 | 1.39 |
| HAPV3 | Análises e Diagnósticos | 48.16 | 4.51 | 13.33 | 1.81 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

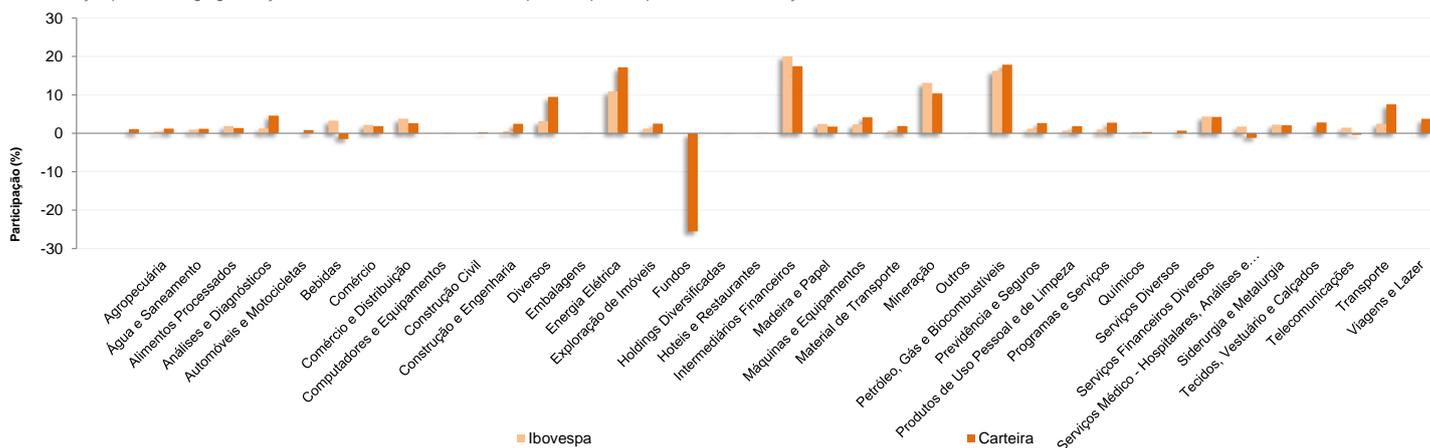
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|-------|--------------|--------------------|
| VALE3 | 112.60 | 10.54 | 0.00 | 1 |
| PETR4 | 83.18 | 7.79 | 0.00 | 1 |
| ITUB4 | 80.69 | 7.55 | 0.00 | 1 |
| EQTL3 | 79.38 | 7.43 | 0.00 | 1 |
| PRI03 | 75.26 | 7.05 | 0.00 | 1 |
| RENT3 | 70.59 | 6.61 | 0.00 | 1 |
| ELET3 | 53.91 | 5.05 | 0.00 | 1 |
| RAIL3 | 50.16 | 4.70 | 0.00 | 1 |
| BPAC11 | 49.68 | 4.65 | 0.00 | 1 |
| HAPV3 | 48.16 | 4.51 | 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

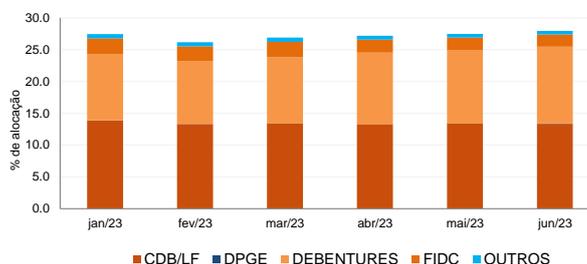
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--|----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 4,304.75 | 3.23 | Faixa 1 |
| BCO ITAU SA | 2,344.89 | 1.76 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 1,983.38 | 1.49 | Faixa 1 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 1,427.96 | 1.07 | Faixa 2 |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 1,118.07 | 0.84 | Faixa 1 |
| BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA) | 600.52 | 0.45 | Faixa 2 |
| COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC | 590.12 | 0.44 | Faixa 1 |
| BCO BTG PACTUAL SA | 565.76 | 0.42 | Faixa 2 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA) | 553.21 | 0.41 | Faixa 2 |
| ENERGISA SA | 518.75 | 0.39 | 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 |
|------------------|-----------------|------------------------------------|----------------|-------------|-----------|--------|--------|-------------------------------------|
| CPLD28 | 18.28 | COPEL DISTRIBUICAO SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 15-jun-27 | CDI | 2.16% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| CPLD28 | 188.66 | COPEL DISTRIBUICAO SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 15-jun-27 | CDI | 2.09% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP |
| CPLD38 | 81.14 | COPEL DISTRIBUICAO SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 15-jun-28 | CDI | 2.25% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP |
| CSAN16 | 5.71 | COSAN SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 20-jun-28 | CDI | 2.40% | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| ENEV19 | 14.42 | ENEVA S.A | Faixa 1 | Faixa 2 | 15-set-32 | IPCA | 7.64% | CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R |
| ENEV19 | 20.53 | ENEVA S.A | Faixa 1 | Faixa 2 | 15-set-32 | IPCA | 7.64% | CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R |
| ERDVA2 | 11.16 | ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 20-jun-26 | CDI | 2.73% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| ERDVA2 | -0.26 | ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 20-jun-26 | CDI | 2.68% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| IRJS12 | 2.88 | IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A. | Faixa 3 | Faixa 2 | 31-jul-25 | CDI | 4.03% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 23.31 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 2.12% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 0.06 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 0.07 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 0.28 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 0.58 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 1.17 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 1.42 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 3.22 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.89% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 3.49 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.92% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| UGEL11 | 1.12 | UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A. | Faixa 2 | Faixa 5 | 08-abr-27 | CDI | 17.92% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 30/06/2023

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 |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|-------------------------------------|-------------|--------------|-------------|----------------------------------|
| ANHBA4 | 14-jun-28 | 21,738 | 0.02% | CDI | CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUEF | 16-jun-23 | 2.19% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| ANHBA4 | 14-jun-28 | 12,540 | 0.01% | CDI | CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUEF | 16-jun-23 | 2.19% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| ARTRA1 | 11-mar-27 | 121,518 | 0.09% | CDI | ARTERIS SA | 27-jun-23 | 2.44% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| CDB CDI | 26-jun-25 | 87,195 | 0.07% | CDI | BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA | 26-jun-23 | 1.32% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| CPLD28 | 15-jun-27 | 188,662 | 0.14% | CDI | COPEL DISTRIBUICAO SA | 20-jun-23 | 2.09% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| CPLD38 | 15-jun-28 | 81,137 | 0.06% | CDI | COPEL DISTRIBUICAO SA | 20-jun-23 | 2.25% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| CSAN16 | 20-jun-28 | 5,706 | 0.00% | CDI | COSAN SA | 30-jun-23 | 2.40% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| CSNAA2 | 20-dez-27 | 64,122 | 0.05% | CDI | CIA SIDERURGICA NACIONAL | 27-jun-23 | 3.34% | Faixa 1 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| ELET13 | 15-abr-26 | 59,957 | 0.04% | CDI | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL | 27-jun-23 | 1.83% | Faixa 1 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| ENEV48 | 15-jul-32 | 97,150 | 0.07% | CDI | ENEVA S.A | 05-jun-23 | 2.30% | Faixa 1 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| ENGIC5 | 15-out-28 | 137,183 | 0.10% | CDI | ENERGISA SA | 30-jun-23 | 1.87% | Faixa 1 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| LF CDI | 30-abr-26 | 100,400 | 0.08% | CDI | BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A. | 21-jun-23 | 1.60% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LF CDI | 15-jun-26 | 50,312 | 0.04% | CDI | BCO GMAC SA | 15-jun-23 | 1.45% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LF CDI | 19-jun-26 | 100,453 | 0.08% | CDI | BCO GMAC SA | 20-jun-23 | 1.45% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LF CDI | 03-dez-26 | 50,173 | 0.04% | CDI | BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A. | 22-jun-23 | 1.70% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LF CDI | 01-jun-27 | 50,174 | 0.04% | CDI | BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A. | 22-jun-23 | 1.80% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LF CDI | 22-jun-27 | 50,144 | 0.04% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 23-jun-23 | 1.70% | Faixa 1 | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| MTRJ19 | 15-dez-31 | 57,575 | 0.04% | IPCA | CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRC | 06-jun-23 | 8.41% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| MTRO12 | 25-abr-27 | 134,026 | 0.10% | CDI | CIA METROPOLITANO SAO PAULO METRI | 30-jun-23 | 40.19% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| MVLV26 | 15-dez-25 | 6,530 | 0.00% | IPCA | MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA | 19-jun-23 | 9.00% | Faixa 2 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| OMGE41 | 15-mai-27 | 86,045 | 0.06% | IPCA | OMEGA GERACAO SA | 05-jun-23 | 7.04% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| RDCO19 | 15-jun-25 | 127,301 | 0.10% | CDI | RODOVIAS COLINAS SA | 30-jun-23 | 1.98% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| RDOB9 | 20-ago-31 | 3,237 | 0.00% | CDI | REDE D OR SAO LUIZ SA | 29-jun-23 | 2.16% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| RDOB9 | 20-ago-31 | 794 | 0.00% | CDI | REDE D OR SAO LUIZ SA | 30-jun-23 | 2.16% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| RMSA12 | 15-jun-42 | 111,289 | 0.08% | IPCA | BRK AMBIENTAL - REGIAO METROPOLIT | 05-jun-23 | 7.94% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| RODB11 | 10-mai-30 | 1,975 | 0.00% | CDI | RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A. | 09-jun-23 | 3.46% | Faixa 2 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| SBSPF8 | 15-jul-28 | 82,360 | 0.06% | CDI | COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST | 09-jun-23 | 1.62% | Faixa 1 | PENSION FI RF CRED PRIV |
| SNGO10 | 15-jun-27 | 84,479 | 0.06% | CDI | SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO | 20-jun-23 | 1.81% | Faixa 2 | PENSION FI RF CRED PRIV |
| SULA29 | 08-nov-28 | 3,277 | 0.00% | CDI | SUL AMERICA SA | 29-jun-23 | 2.13% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| SULA29 | 08-nov-28 | 387 | 0.00% | CDI | SUL AMERICA SA | 29-jun-23 | 2.14% | Faixa 1 | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| TIET19 | 15-mar-27 | 127,409 | 0.10% | CDI | AES TIETE ENERGIA SA | 30-jun-23 | 1.71% | Faixa 2 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| USIM28 | 23-mai-29 | 140,155 | 0.11% | CDI | USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S | 30-jun-23 | 2.23% | Faixa 1 | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|-----------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|------------------------------------|
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 134,319 | 0.10% | Selic | | 28-jun-23 | 0.00% | 0.00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 26,886 | 0.02% | Selic | | 19-jun-23 | 0.00% | 0.00% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 228,530 | 0.17% | Selic | | 28-jun-23 | 0.00% | 0.00% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 33,580 | 0.03% | Selic | | 22-jun-23 | 0.00% | 0.00% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 167,884 | 0.13% | Selic | | 29-jun-23 | 0.01% | 0.01% | BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 107,534 | 0.08% | Selic | | 02-jun-23 | 0.02% | 0.02% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 3,010,473 | 2.26% | Selic | | 15-jun-23 | 0.03% | 0.03% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 11,412 | 0.01% | Selic | | 16-jun-23 | 0.02% | 0.02% | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 187,873 | 0.14% | Selic | | 06-jun-23 | 0.08% | 0.00% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2026-09-01 | 01-set-26 | 1,220,329 | 0.91% | Selic | | 12-jun-23 | 0.08% | 0.08% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| LFT 2026-09-01 | 01-set-26 | 348,665 | 0.26% | Selic | | 09-jun-23 | 0.08% | 0.08% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 201,061 | 0.15% | IPCA | | 26-jun-23 | 6.13% | 6.17% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 90,677 | 0.07% | IPCA | | 23-jun-23 | 6.19% | 6.15% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 90,045 | 0.07% | IPCA | | 07-jun-23 | 6.20% | 6.35% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 64,076 | 0.05% | IPCA | | 23-jun-23 | 6.20% | 6.15% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 48,042 | 0.04% | IPCA | | 23-jun-23 | 6.21% | 6.15% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 48,042 | 0.04% | IPCA | | 23-jun-23 | 6.21% | 6.15% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 47,063 | 0.04% | IPCA | | 02-jun-23 | 6.29% | 6.31% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 37,332 | 0.03% | IPCA | | 05-jun-23 | 6.24% | 6.21% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 34,251 | 0.03% | IPCA | | 26-jun-23 | 6.13% | 6.17% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 34,027 | 0.03% | IPCA | | 06-jun-23 | 6.17% | 6.26% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 25,500 | 0.02% | IPCA | | 16-jun-23 | 6.32% | 6.29% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 19,359 | 0.01% | IPCA | | 01-jun-23 | 6.33% | 6.34% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 18,135 | 0.01% | IPCA | | 23-jun-23 | 6.21% | 6.15% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 16,361 | 0.01% | IPCA | | 01-jun-23 | 6.34% | 6.34% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 15,137 | 0.01% | IPCA | | 27-jun-23 | 6.15% | 6.12% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 14,729 | 0.01% | IPCA | | 07-jun-23 | 6.19% | 6.35% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 4,202 | 0.00% | IPCA | | 06-jun-23 | 6.16% | 6.26% | ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 245 | 0.00% | IPCA | | 01-jun-23 | 5.46% | 5.47% | AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV |
| NTN-B 2035-05-15 | 15-mai-35 | 4,435 | 0.00% | IPCA | | 02-jun-23 | 5.54% | 5.47% | RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (|