

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5,217,312.30</b>	<b>100%</b>			<b>1.10%</b>	<b>3.16%</b>	<b>6.38%</b>	<b>6.38%</b>				
Benchmark:	CDI				1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>5,217,312.30</b>	<b>100%</b>		<b>0.02%</b>								
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4,275,431.21	81.93%	ITAÚ	0.01%	0.03%	1.09%	3.18%	6.55%	6.55%	13.64%	23.75%	26.38%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	941,881.09	18.05%	ITAÚ	0.03%	0.00%	1.26%	3.46%	6.47%	6.47%	14.34%	26.12%	29.94%
Benchmark:	CDI				1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
<b>Total</b>	<b>5,218,101.67</b>	<b>100%</b>		<b>0.02%</b>	<b>1.10%</b>	<b>3.16%</b>	<b>6.38%</b>	<b>6.38%</b>				
Benchmark:	CDI				1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	

\* 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.

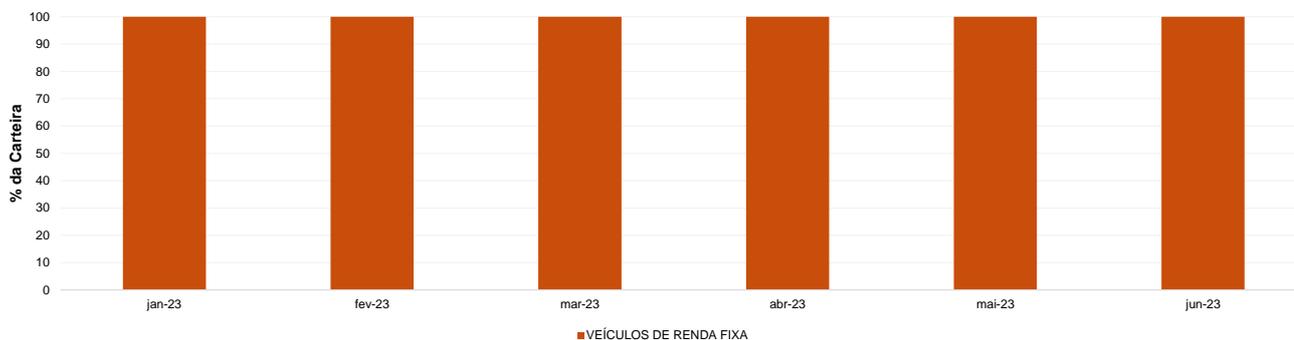
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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

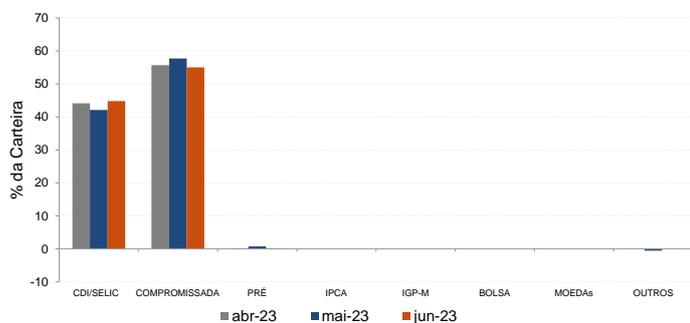
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

### Evolução do Patrimônio Líquido

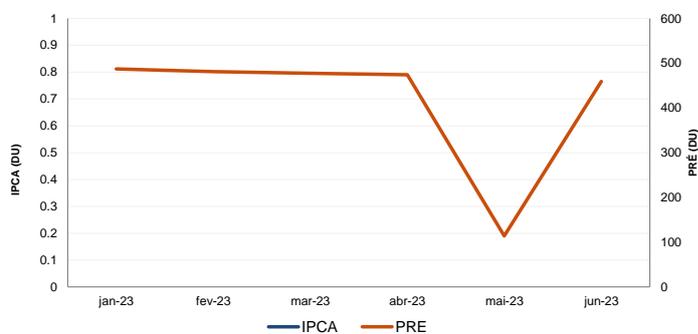


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

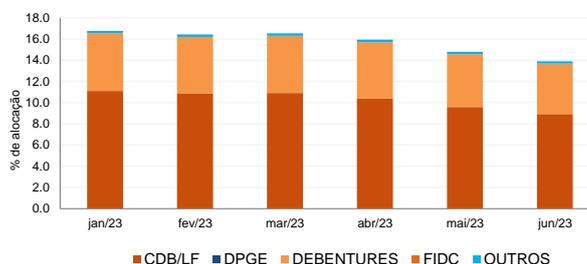
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	120.73	2.32	Faixa 1
BCO ITAU SA	74.10	1.42	Faixa 1
BCO SAFRA SA	60.80	1.17	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	39.90	0.77	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	27.94	0.54	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	25.82	0.50	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	23.10	0.44	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	16.97	0.33	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	14.15	0.27	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	13.88	0.27	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	4.45	COPEL DISTRIBUICAO SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-jun-27	CDI	2.09%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CPLD38	1.93	COPEL DISTRIBUICAO SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-jun-28	CDI	2.25%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	567	0.01%	CDI	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUEF	16-jun-23	2.19%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CDB CDI	24-jul-23	126	0.00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	27-jun-23	0.40%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CDB CDI	26-ago-24	117	0.00%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-jun-23	1.13%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CDB CDI	26-jun-25	1,838	0.04%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	26-jun-23	1.30%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CPLD28	15-jun-27	4,453	0.09%	CDI	COPEL DISTRIBUICAO SA	20-jun-23	2.09%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CPLD38	15-jun-28	1,933	0.04%	CDI	COPEL DISTRIBUICAO SA	20-jun-23	2.25%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	31-jul-23	454	0.01%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVT	27-jun-23	0.71%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-jan-24	666	0.01%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	27-jun-23	0.81%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	25-mar-24	36	0.00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	27-jun-23	0.91%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-ago-24	57	0.00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	27-jun-23	1.18%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-nov-24	132	0.00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-jun-23	1.26%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	18-dez-24	33	0.00%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-jun-23	1.17%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	25-mar-25	36	0.00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	27-jun-23	1.26%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-jul-25	173	0.00%	CDI	BCO GMAC SA	27-jun-23	1.23%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	29-ago-25	51	0.00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	27-jun-23	1.30%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-nov-25	99	0.00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-jun-23	1.34%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-nov-25	49	0.00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-jun-23	1.34%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-abr-26	549	0.01%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	21-jun-23	1.60%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	15-jun-26	504	0.01%	CDI	BCO GMAC SA	15-jun-23	1.45%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	19-jun-26	2,503	0.05%	CDI	BCO GMAC SA	20-jun-23	1.45%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-nov-26	99	0.00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-jun-23	1.48%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	03-dez-26	290	0.01%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	22-jun-23	1.70%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	01-jun-27	259	0.00%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	22-jun-23	1.80%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-jun-27	960	0.02%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-jun-23	1.70%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Semestral	23-set-24	32	0.00%	CDI	BCO JOHN DEERE SA	27-jun-23	1.27%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Semestral	04-mai-25	31	0.00%	CDI	BCO JOHN DEERE SA	27-jun-23	1.34%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF PRE Mensal	01-jul-26	1,051	0.02%	PRE	BCO TOYOTA BRASIL SA	23-jun-23	12.15%	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	37,069	0.71%	Selic	27-jun-23	0.03%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	29,396	0.56%	Selic	01-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	12,755	0.24%	Selic	05-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	5,879	0.11%	Selic	01-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	4,144	0.08%	Selic	07-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1,181	0.02%	Selic	05-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	874	0.02%	Selic	30-jun-23	0.02%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	615	0.01%	Selic	19-jun-23	0.03%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	438	0.01%	Selic	21-jun-23	0.03%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	437	0.01%	Selic	30-jun-23	0.02%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	175	0.00%	Selic	09-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	175	0.00%	Selic	12-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	132	0.00%	Selic	15-jun-23	0.02%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	61	0.00%	Selic	21-jun-23	0.03%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	16	0.00%	Selic	30-jun-23	0.02%	0.03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	9,215	0.18%	Selic	02-jun-23	0.01%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	175	0.00%	Selic	21-jun-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	175	0.00%	Selic	21-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	350	0.01%	Selic	21-jun-23	0.02%	0.02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	879	0.02%	Selic	15-jun-23	0.08%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	526	0.01%	Selic	26-jun-23	7.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	613	0.01%	Selic	26-jun-23	0.13%	0.13%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	10,626	0.20%	Selic	01-jun-23	0.15%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	10,626	0.20%	Selic	01-jun-23	0.15%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	2,125	0.04%	Selic	01-jun-23	0.15%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	471	0.01%	Selic	27-jun-23	0.13%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	15,195	0.29%	Selic	02-jun-23	0.17%	0.16%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	10,987	0.21%	Selic	05-jun-23	0.16%	0.16%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	8,182	0.16%	Selic	01-jun-23	0.17%	0.17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI