

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 31/05/2023

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	125.390.837,48	94,36%				1,07%	3,06%	6,18%	4,98%			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	86.171.518,47	64,84%										
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI CP RF	86.171.518,47	64,84%		100%	0,29%	0,95%	2,98%	6,51%	5,29%	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
RF CRÉDITO	20.105.116,78	15,13%										
PENSION FI RF CRED PRIV	7.424.417,98	5,59%	SAFRA	8,12%	0,01%	1,22%	3,24%	6,52%	5,18%	14,58%	28,65%	-
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	3.262.246,61	2,45%	ARX	1,61%	0,03%	1,26%	2,55%	4,10%	2,83%	-	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	607.837,41	0,46%	AUGME	0,31%	0,22%	1,10%	2,95%	2,12%	0,81%	9,54%	22,69%	31,59%
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	8.231.240,28	6,19%	CAPITANIA CAPITAL	9,43%	0,22%	1,28%	2,41%	2,70%	1,47%	9,92%	22,55%	-
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	579.374,50	0,44%	CAPTALYS	0,07%	0,00%	1,07%	2,88%	-2,58%	-1,85%	-3,62%	6,45%	16,21%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
RF REFERENCIADO DI	10.387.485,64	7,82%										
BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	10.387.485,64	7,82%	BRADESCO	0,10%	0,03%	1,11%	3,17%	6,41%	5,25%	13,20%	21,97%	24,14%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
RF	8.336.031,83	6,27%										
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	8.336.031,83	6,27%	ITAÚ	0,50%	0,40%	1,83%	4,48%	7,82%	6,61%	11,96%	22,41%	26,51%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
FIDC	390.684,76	0,29%										
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	21.781,78	0,02%	BNY MELLON	0,00%		1,46%	4,25%	8,60%	7,03%	17,86%	30,10%	33,79%
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	63.367,09	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	305.535,89	0,23%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Estruturado	7.552.595,75	5,68%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,38%	4,02%	8,13%	6,65%	16,87%	29,87%	36,67%
MM FIC	5.024.994,10	3,78%										
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	5.024.994,10	3,78%	ITAÚ	1,07%	1,50%	1,01%	0,02%	3,63%	2,24%	10,44%	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
MM MACRO	2.527.601,65	1,90%										
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.527.601,65	1,90%	ITAÚ	0,82%	1,99%	-1,01%	0,66%	2,43%	1,66%	8,59%	21,66%	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Total	132.888.462,72	100%										
Benchmark:	IPCA + 7.2% a.a.					0,84%	3,34%	7,23%	5,92%	11,39%	33,42%	54,50%

* 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.

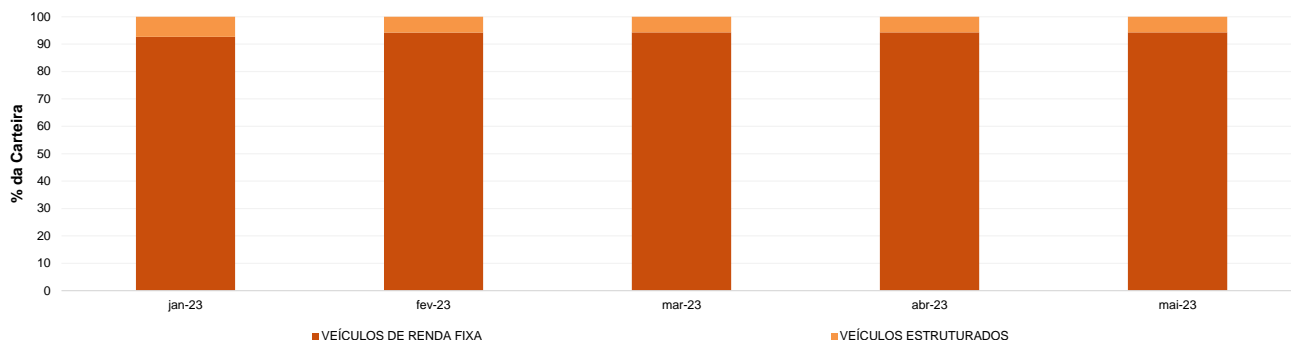
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

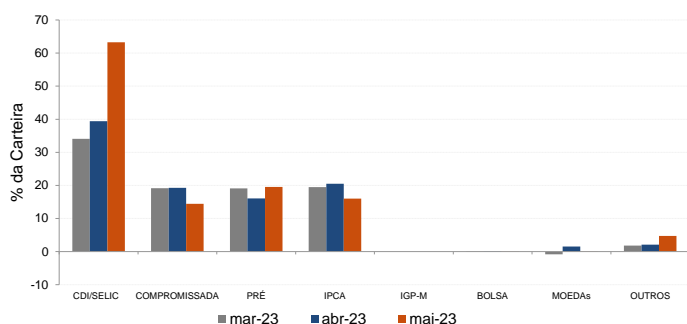
Distribuição da Carteira

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.

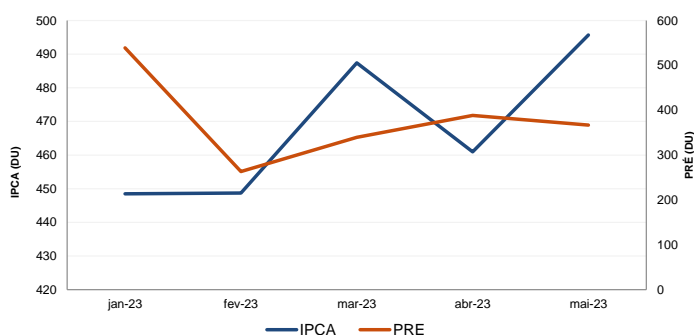
Evolução do Patrimônio Líquido



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

Nome	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	69,78	9,45	78,44	8,88
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	58,40	7,91	74,38	8,42
EQTL3	Energia Elétrica	48,12	6,52	72,33	8,19
ITUB4	Intermediários Financeiros	47,67	6,46	58,29	6,60
ELET3	Energia Elétrica	36,81	4,99	76,64	8,68
GOAU4	Siderurgia e Metalurgia	28,61	3,88	33,72	3,82
BBAS3	Intermediários Financeiros	27,50	3,73	41,99	4,75
CIEL3	Serviços Financeiros Diversos	26,33	3,57	69,50	7,87
RAIL3	Transporte	24,74	3,35	-9,87	-1,12
SMTO3	Alimentos Processados	22,79	3,09	-3,58	-0,41

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

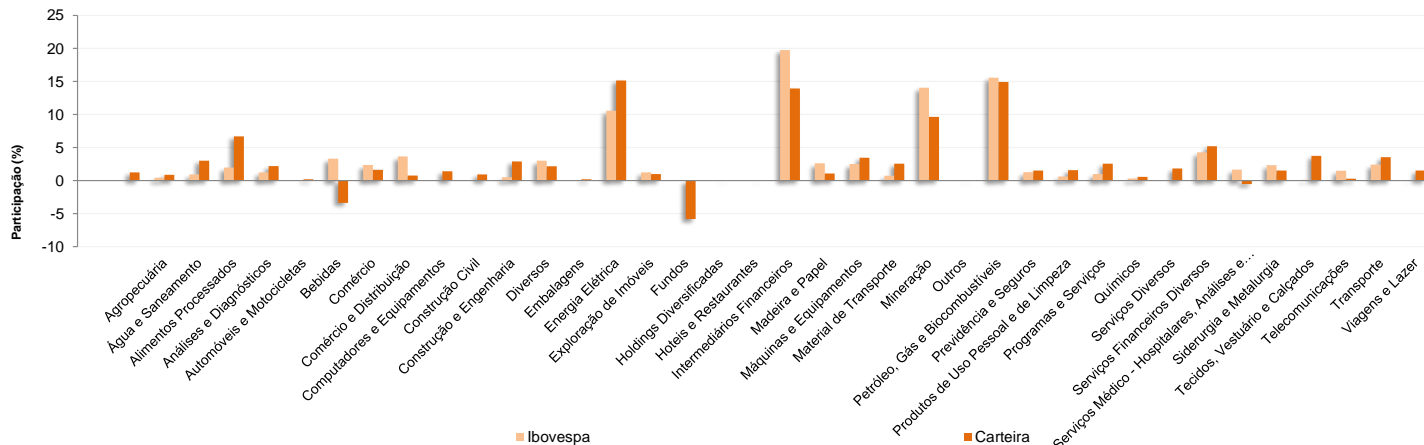
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	-0,07	-0,01	0,00	Sem Liquidez
VALE3	69,78	9,45	0,00	1
PRI03	58,40	7,91	0,00	1
EQTL3	48,12	6,52	0,00	1
ITUB4	47,67	6,46	0,00	1
ELET3	36,81	4,99	0,00	1
GOAU4	28,61	3,88	0,00	1
BBAS3	27,50	3,73	0,00	1
CIEL3	26,33	3,57	0,00	1
RAIL3	24,74	3,35	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.



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.

Análises de Contrapartes

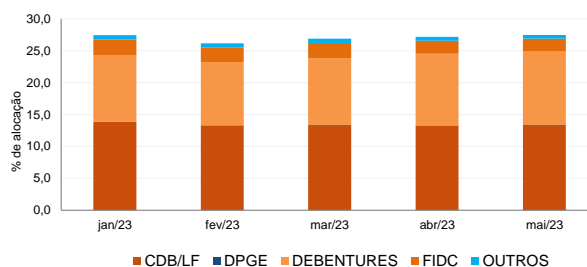
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.264,05	3,21	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.982,26	1,49	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.839,85	1,38	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.431,55	1,08	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.063,88	0,80	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	844,51	0,64	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	591,38	0,44	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	554,39	0,42	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	542,07	0,41	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	516,11	0,39	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
BBML13	188,37	BBM LOGISTICA SA	Faixa 4	Faixa 5	20-dez-26	CDI	4,25%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FIDC



RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI

Data-base: 31/05/2023

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
ANEM11	15-jun-39	60.492	0,05%	IPCA	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	31-mai-23	9,43%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ANET12	15-nov-30	164.988	0,12%	IPCA	AMERICA NET S.A.	31-mai-23	10,12%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ARML13	04-nov-29	707	0,00%	CDI	ARMAC LOCAÇÃO, LOGÍSTICA E SERVIÇOS	04-mai-23	2,88%	Faixa 3	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CBAN32	15-jul-34	98.575	0,07%	IPCA	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	09-mai-23	6,12%	Faixa 1	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CBRDB8	10-mai-28	56.066	0,04%	CDI	COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	30-mai-23	9,90%	Faixa 4	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CSAN24	05-mai-32	3.581	0,00%	CDI	COSAN SA	31-mai-23	2,24%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
DASAC5	30-out-31	33.608	0,03%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	17-mai-23	2,74%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
HBSA12	20-jul-27	3.697	0,00%	CDI	HIDROVIAS BRASIL SA	23-mai-23	3,19%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
HVRD15	15-abr-36	181.764	0,14%	IPCA	BRVIAS HOLDING VRD SA	31-mai-23	8,86%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
IOCHB1	15-abr-27	142.491	0,11%	CDI	IOCHPE MAXION SA	11-mai-23	2,50%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	100.485	0,08%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	31-mai-23	8,16%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	84.619	0,06%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	05-mai-23	9,59%	Faixa 2	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
KLBN2	19-mar-29	90.401	0,07%	CDI	KLABIN SA	31-mai-23	114,65%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
LF CDI	21-set-26	625.367	0,47%	CDI	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	31-mai-23	1,83%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LIGHD3	15-out-50	103	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	103	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
QUAT13	15-jul-34	82.552	0,06%	IPCA	ACUCAREIRA QUATA S.A.	31-mai-23	26,50%	Faixa 3	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	664.365	0,50%	Selic	05-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	585.188	0,44%	Selic	22-mai-23	0,00%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2024-09-01	01-set-24	72.756	0,05%	Selic	19-mai-23	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	19.267	0,01%	Selic	09-mai-23	0,03%	0,03%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2025-09-01	01-set-25	265.810	0,20%	Selic	19-mai-23	4,00%	0,04%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2025-09-01	01-set-25	42.373	0,03%	Selic	09-mai-23	4,00%	0,04%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	225.619	0,17%	Selic	25-mai-23	0,08%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2026-03-01	01-mar-26	212.348	0,16%	Selic	15-mai-23	0,09%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2026-03-01	01-mar-26	183.176	0,14%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	79.630	0,06%	Selic	30-mai-23	0,08%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2026-03-01	01-mar-26	73.265	0,06%	Selic	26-mai-23	0,08%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-03-01	01-mar-27	952.598	0,72%	Selic	18-mai-23	0,15%	0,15%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
LFT 2027-03-01	01-mar-27	127.823	0,10%	Selic	29-mai-23	0,14%	0,14%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	143.612	0,11%	Selic	12-mai-23	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	47.871	0,04%	Selic	12-mai-23	0,17%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2027-09-01	01-set-27	25.531	0,02%	Selic	09-mai-23	0,18%	0,00%	BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXT
LFT 2028-03-01	01-mar-28	9.966	0,01%	Selic	17-mai-23	39,61%	0,17%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LTN 2026-07-01	01-jul-26	530.740	0,40%	PRE	17-mai-23	11,38%	11,45%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	363.521	0,27%	PRE	10-mai-23	11,70%	11,62%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	254.465	0,19%	PRE	05-mai-23	11,66%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	181.760	0,14%	PRE	04-mai-23	11,78%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	127.232	0,10%	PRE	05-mai-23	11,66%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	109.056	0,08%	PRE	04-mai-23	11,85%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	95.424	0,07%	PRE	05-mai-23	11,62%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	72.704	0,05%	PRE	04-mai-23	11,86%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	31.808	0,02%	PRE	05-mai-23	11,65%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	16.468	0,01%	IPCA	23-mai-23	7,47%	7,43%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	173.465	0,13%	IPCA	22-mai-23	6,23%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	105.873	0,08%	IPCA	03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	105.729	0,08%	IPCA	03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	99.120	0,07%	IPCA	22-mai-23	6,24%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	65.806	0,05%	IPCA	03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	49.550	0,04%	IPCA	22-mai-23	6,26%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	36.981	0,03%	IPCA	16-mai-23	5,93%	5,96%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	26.437	0,02%	IPCA	03-mai-23	5,95%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	25.268	0,02%	IPCA	31-mai-23	6,36%	6,37%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	4.618	0,00%	IPCA	31-mai-23	6,35%	6,37%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	2.278	0,00%	IPCA	15-mai-23	5,91%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.232	0,00%	IPCA	05-mai-23	5,85%	5,80%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.047	0,00%	IPCA	15-mai-23	5,90%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	29.484	0,02%	IPCA	18-mai-23	5,46%	0,00%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	21.432	0,02%	IPCA	23-mai-23	5,59%	5,58%	RBSPREV PERFIL CONSERVADOR RAI (