

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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
<b>Renda Fixa</b>	<b>85.584.608,28</b>	<b>72,54%</b>				<b>1,26%</b>	<b>3,33%</b>	<b>5,49%</b>	<b>4,72%</b>			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>55.997.370,51</b>	<b>47,46%</b>										
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	55.997.370,51	47,46%		100%	0,12%	1,10%	3,03%	5,08%	4,35%	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>RF CRÉDITO</b>	<b>18.860.302,59</b>	<b>15,98%</b>										
PENSION FI RF CRED PRIV	7.959.788,30	6,75%	SAFRA	8,71%	0,01%	1,22%	3,24%	6,52%	5,18%	14,58%	28,65%	-
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	7.375.068,31	6,25%	ARX	3,65%	0,03%	1,26%	2,55%	4,10%	2,83%	-	-	-
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	907.694,66	0,77%	AUGME	0,47%	0,22%	1,10%	2,95%	2,12%	0,81%	9,54%	22,69%	31,59%
CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2.181.916,95	1,85%	CAPITANIA CAPITAL	2,50%	0,22%	1,28%	2,41%	2,70%	1,47%	9,92%	22,55%	-
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	435.834,36	0,37%	CAPTALYS	0,05%	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%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>6.112.189,69</b>	<b>5,18%</b>										
GERI TENAX FI RF LP	3.059.747,64	2,59%	TENAX CAPITAL	2,55%	0,91%	2,47%	6,74%	10,00%	9,12%	13,63%	17,36%	22,62%
ITAU GERI RF FI	3.052.442,05	2,59%	ITAU	7,05%	1,20%	2,32%	6,24%	8,17%	7,88%	11,62%	8,92%	8,28%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>RF</b>	<b>4.097.172,31</b>	<b>3,47%</b>										
ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4.097.172,31	3,47%	ITAU	0,25%	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%
<b>FIDC</b>	<b>517.573,18</b>	<b>0,44%</b>										
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	70.419,40	0,06%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	428.598,93	0,36%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18.554,85	0,02%	BNY MELLON	0,00%		1,46%	4,25%	8,60%	7,03%	17,86%	30,10%	33,79%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>Renda Variável</b>	<b>5.549.095,40</b>	<b>4,70%</b>				<b>5,37%</b>	<b>3,86%</b>	<b>2,28%</b>	<b>-0,85%</b>			
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					4,01%	4,01%	-2,27%	-0,08%	0,20%	-8,95%	35,41%
<b>RV VALOR</b>	<b>2.136.106,84</b>	<b>1,81%</b>										
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	914.509,21	0,78%	ABSOLUTO PARTNERS	0,26%	11,22%	7,01%	4,60%	-3,35%	1,33%	-8,60%	-37,98%	-9,55%
BOGARI VALUE T INSTIT. FIC FIA	450.363,66	0,38%	BOGARI	4,18%	16,31%	11,79%	5,74%	-6,19%	-1,61%	-14,60%	-	-
KIRON INSTIT. FIA	414.898,13	0,35%	KIRON CAPITAL	0,81%	12,21%	6,83%	1,63%	-7,07%	-3,27%	-2,14%	-21,74%	6,83%
LIS VALUE FIA	356.335,85	0,30%	LIS CAPITAL	0,22%	8,81%	6,15%	2,78%	-5,72%	-2,21%	-9,04%	-30,68%	2,95%
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
<b>RV PASSIVO</b>	<b>1.488.098,88</b>	<b>1,26%</b>										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.488.098,88	1,26%	BLACKROCK	0,01%	8,87%	3,90%	3,65%	-3,44%	-1,05%	-2,18%	-13,53%	24,54%
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
<b>RV ATIVO</b>	<b>939.015,13</b>	<b>0,80%</b>										
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	295.112,54	0,25%	OCEANA	0,07%	8,38%	4,93%	3,86%	-1,88%	0,60%	0,94%	-6,64%	34,25%
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	340.639,49	0,29%	AZ QUEST	0,13%	11,01%	2,05%	0,03%	-7,43%	-3,77%	-9,03%	-25,30%	2,86%
XP INVESTOR FIA	303.263,10	0,26%	XP	0,15%	9,95%	5,21%	6,40%	2,16%	3,80%	2,64%	-7,50%	24,91%
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>552.015,06</b>	<b>0,47%</b>										
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	552.015,06	0,47%	AZ QUEST	0,07%	13,21%	4,56%	3,54%	-1,23%	0,58%	-7,32%	-25,59%	9,45%
Benchmark:	SMLL					13,54%	13,69%	1,56%	4,71%	-7,34%	-32,24%	6,89%
<b>RV LONG BIAS</b>	<b>460.498,96</b>	<b>0,39%</b>										
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	460.498,96	0,39%	SHARP	0,91%	3,53%	2,39%	2,75%	-1,12%	1,08%	8,67%	4,26%	-
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>-26.639,47</b>	<b>-0,02%</b>										
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	-26.639,47	-0,02%		100%	0,00%	3,90%	3,65%	-4,20%	-1,05%	-	-	-
Benchmark:	IBX					3,59%	2,36%	-4,66%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%
<b>Estruturado</b>	<b>20.514.136,98</b>	<b>17,39%</b>				<b>1,66%</b>	<b>3,80%</b>	<b>4,67%</b>	<b>4,33%</b>			
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1,38%	4,02%	8,13%	6,65%	16,87%	29,87%	36,67%

\* 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 PERFIL MODERADO 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
<b>MM MACRO</b>	<b>13.310.817,48</b>	<b>11,28%</b>										
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIMEN	4.243.452,71	3,60%	ITAÚ	3,16%	1,16%	0,34%	1,55%	4,93%	3,66%	13,59%	36,86%	-
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2.453.694,38	2,08%	ITAÚ	0,80%	1,99%	-1,01%	0,66%	2,43%	1,66%	8,59%	21,66%	-
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	317.144,60	0,27%	IBIUNA	0,01%	2,24%	0,09%	-0,12%	-0,67%	-0,28%	4,45%	26,77%	38,81%
SOLANA EQ.HEDG. VIII FIC FI MULT	812.531,98	0,69%	SOLANA	1,21%	2,92%	3,80%	1,22%	0,52%	-1,13%	10,87%	11,17%	-
CLAVE ALPHA MACRO II FIC FI MULT	101.612,99	0,09%	CLAVE	0,02%	2,04%	0,83%	2,43%	7,28%	3,93%	13,28%	-	-
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1.179.330,01	1,00%	SPX	1,70%	2,55%	-0,85%	-1,15%	1,19%	1,10%	3,37%	28,23%	42,66%
GENOA TL FIC FI MULT	814.256,97	0,69%	GENOA	0,65%	1,64%	1,89%	4,44%	7,84%	6,72%	18,67%	39,37%	-
KAPITALO ZETA FIC FI MULT	592.418,28	0,50%	KAPITALO	0,03%	15,28%	-1,04%	-0,22%	1,99%	1,47%	9,75%	26,26%	50,36%
NW3 EVENT DRIVEN PLUS FIC FI MULT	416.228,05	0,35%	NW3	0,17%	1,38%	-2,59%	-1,52%	1,00%	-0,54%	8,42%	17,53%	25,27%
RPS TOTAL RETURN FIC FI MULT D30 TAG	586.624,80	0,50%	RPS CAPITAL	1,86%	7,13%	7,48%	5,36%	6,08%	3,05%	6,97%	5,98%	23,89%
CLAVE ALPHA MACRO FIC FI MULT	714.679,55	0,61%	CLAVE	0,25%	2,04%	0,83%	2,43%	7,28%	3,93%	13,29%	26,66%	-
VISTA HEDGE D30 FIC FI MULT	522.268,40	0,44%	VISTA	0,11%	1,38%	1,29%	-0,13%	-0,72%	-0,52%	-6,20%	-	-
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	556.574,75	0,47%	ZEITGEIST	0,04%	1,36%	0,77%	0,25%	0,08%	0,74%	1,74%	18,64%	19,83%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>MM FIC</b>	<b>7.203.319,50</b>	<b>6,11%</b>										
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	2.624.986,11	2,22%	ITAÚ	0,56%	1,50%	1,01%	0,02%	3,63%	2,24%	10,44%	-	-
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4.578.333,39	3,88%	ITAÚ	1,13%	6,56%	5,63%	14,99%	9,02%	12,00%	8,44%	-	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>Exterior</b>	<b>6.389.742,48</b>	<b>5,42%</b>				<b>0,98%</b>	<b>-2,25%</b>	<b>-0,50%</b>	<b>-1,63%</b>			
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0,63%	0,95%	-0,93%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%
<b>MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>5.453.510,83</b>	<b>4,62%</b>										
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	568.355,89	0,48%	ITAÚ	1,02%	2,71%	0,34%	-0,26%	-0,50%	0,33%	4,41%	-10,84%	-
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4.885.154,94	4,14%	TAG INVEST	10,97%	2,43%	1,11%	-2,74%	-0,73%	-2,08%	7,54%	-9,99%	-
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>RF INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>936.231,66</b>	<b>0,79%</b>										
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	936.231,66	0,79%	ITAÚ	2,57%	3,06%	0,64%	-0,84%	-0,20%	-1,68%	1,95%	-8,87%	-6,46%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>Total</b>	<b>117.988.145,57</b>	<b>100%</b>			<b>1,02%</b>	<b>1,46%</b>	<b>3,34%</b>	<b>4,83%</b>	<b>4,48%</b>	<b>9,31%</b>	<b>14,78%</b>	<b>23,68%</b>
Benchmark:	IPCA + 8.1% a.a.					0,91%	3,55%	7,67%	6,28%	12,32%	35,66%	58,42%

\* 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.

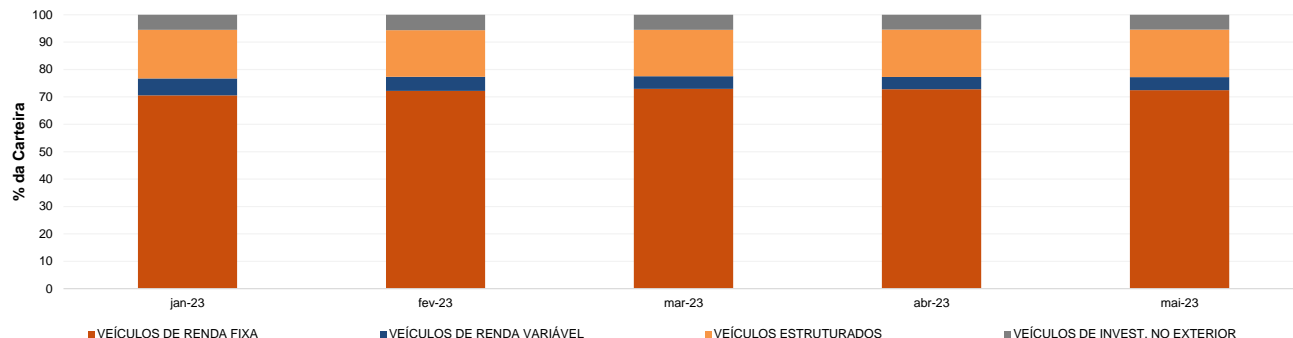
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

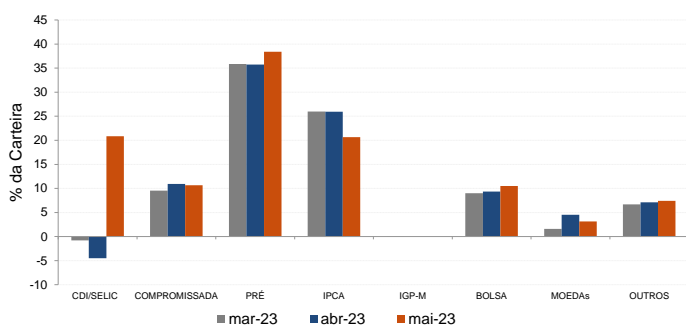
## Distribuição da Carteira

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.

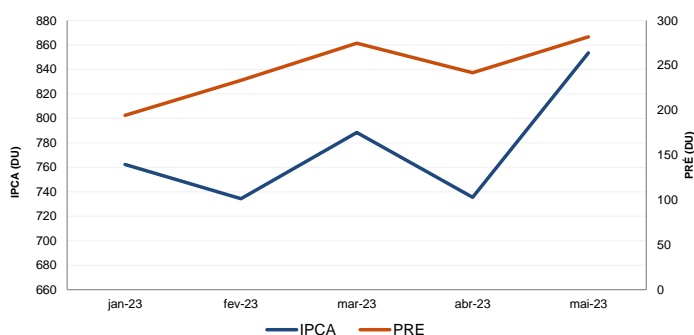
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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*	%
IDTP LN		955,05	7,34	948,21	7,51
EQTL3	Energia Elétrica	494,74	3,80	523,82	4,15
IGTI11	Exploração de Imóveis	452,61	3,48	491,37	3,89
ENGI11	Energia Elétrica	450,36	3,46	446,30	3,54
ALSO3	Exploração de Imóveis	414,66	3,19	422,37	3,35
VALE3	Mineração	374,86	2,88	444,59	3,52
ELET3	Energia Elétrica	373,03	2,87	351,09	2,78
SBSP3	Água e Saneamento	358,77	2,76	313,66	2,49
ITUB4	Intermediários Financeiros	351,77	2,70	366,07	2,90
CPFE3	Energia Elétrica	315,88	2,43	328,42	2,60

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

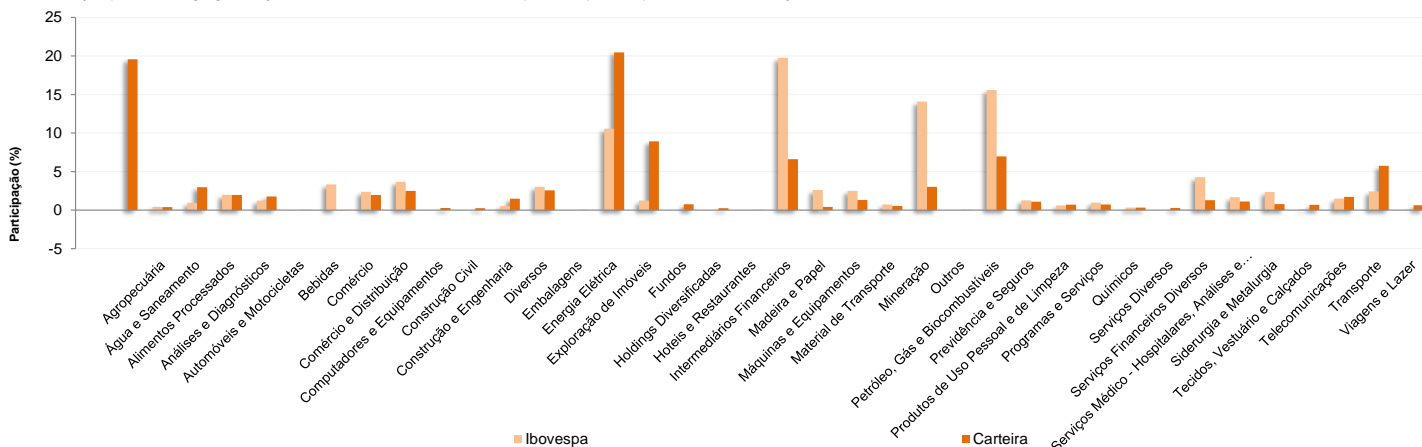
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	4,16	0,03	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	33,03	0,25	0,44	25
MTSA4	43,92	0,34	0,05	3
EQTL3	494,74	3,80	0,00	1
IGTI11	452,61	3,48	0,00	1
ENGI11	450,36	3,46	0,01	1
ALSO3	414,66	3,19	0,01	1
VALE3	374,86	2,88	0,00	1
ELET3	373,03	2,87	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

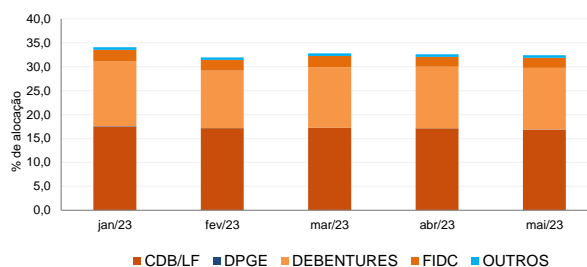
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.577,82	5,64	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.764,75	2,37	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.558,13	1,34	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.524,60	1,31	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	932,67	0,80	Faixa 1
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	899,66	0,77	Faixa 1
ENERGISA SA	858,97	0,74	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	715,37	0,61	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	683,85	0,59	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	664,36	0,57	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	0,01	BBM LOGISTICA SA	Faixa 4	Faixa 5	20-dez-26	CDI	4,20%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
BBML13	49,93	BBM LOGISTICA SA	Faixa 4	Faixa 5	20-dez-26	CDI	4,25%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
BBML13	0,33	BBM LOGISTICA SA	Faixa 4	Faixa 5	20-dez-26	CDI	4,25%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT
EUFA14	0,26	EUROFARMA LABORATÓRIOS S/A	Sem Faixa	Faixa 1	15-mai-29	CDI	2,30%	IBIUNA HEDGE ST MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO 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	16.035	0,01%	IPCA	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	31-mai-23	9,43%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ANET12	15-nov-30	43.735	0,04%	IPCA	AMERICA NET S.A.	31-mai-23	10,12%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ARML13	04-nov-29	1.056	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	26.130	0,02%	IPCA	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	09-mai-23	6,12%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CBRDB8	10-mai-28	14.862	0,01%	CDI	COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	30-mai-23	9,90%	Faixa 4	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CSAN24	05-mai-32	5.348	0,00%	CDI	COSAN SA	31-mai-23	2,24%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
DASAC5	30-out-31	8.909	0,01%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	17-mai-23	2,74%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
HBSA12	20-jul-27	5.521	0,00%	CDI	HIDROVIAS BRASIL SA	23-mai-23	3,19%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
HVRD15	15-abr-36	48.181	0,04%	IPCA	BRVIAS HOLDING VRD SA	31-mai-23	8,86%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
IOCHB1	15-abr-27	37.771	0,03%	CDI	IOCHPE MAXION SA	11-mai-23	2,50%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	26.636	0,02%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	31-mai-23	8,16%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	22.431	0,02%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	05-mai-23	9,59%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
KLBN2	19-mar-29	96.920	0,08%	CDI	KLABIN SA	31-mai-23	114,65%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
LIGHD3	15-out-50	27	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	27	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
QUAT13	15-jul-34	21.883	0,02%	IPCA	ACUCAREIRA QUATA S.A.	31-mai-23	26,50%	Faixa 3	CAPITANIA 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	326.537	0,28%	Selic		05-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	545.289	0,47%	Selic		22-mai-23	0,00%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2024-03-01	01-mar-24	95.653	0,08%	Selic		22-mai-23	0,00%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	23.442	0,02%	Selic		19-mai-23	0,01%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	9.377	0,01%	Selic		30-mai-23	0,01%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.751	0,00%	Selic		26-mai-23	0,01%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	319.076	0,27%	Selic		19-mai-23	0,03%	0,03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	135.927	0,12%	Selic		18-mai-23	0,03%	0,03%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	66.474	0,06%	Selic		08-mai-23	0,03%	0,03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-03-01	01-mar-25	11.249	0,01%	Selic		03-mai-23	0,03%	0,03%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	678.115	0,58%	Selic		08-mai-23	4,00%	0,04%	GERI TENAX FI RF LP
LFT 2025-09-01	01-set-25	398.714	0,34%	Selic		31-mai-23	0,03%	0,03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2026-03-01	01-mar-26	159.261	0,14%	Selic		15-mai-23	0,09%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2026-03-01	01-mar-26	66.359	0,06%	Selic		25-mai-23	0,08%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2026-03-01	01-mar-26	66.359	0,06%	Selic		30-mai-23	0,08%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2027-09-01	01-set-27	845.641	0,73%	Selic		18-mai-23	0,16%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2028-03-01	01-mar-28	2.642	0,00%	Selic		17-mai-23	39,61%	0,17%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LTN 2026-07-01	01-jul-26	260.860	0,22%	PRE		17-mai-23	11,38%	11,45%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	178.671	0,15%	PRE		10-mai-23	11,70%	11,62%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	125.070	0,11%	PRE		05-mai-23	11,66%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	89.336	0,08%	PRE		04-mai-23	11,78%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	62.535	0,05%	PRE		05-mai-23	11,66%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	53.601	0,05%	PRE		04-mai-23	11,85%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	46.901	0,04%	PRE		05-mai-23	11,62%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	35.734	0,03%	PRE		04-mai-23	11,86%	11,63%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LTN 2026-07-01	01-jul-26	15.634	0,01%	PRE		05-mai-23	11,65%	11,60%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	225.814	0,19%	IPCA		09-mai-23	6,82%	6,78%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	32.936	0,03%	IPCA		22-mai-23	7,46%	7,48%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	2.032	0,00%	IPCA		16-mai-23	7,03%	7,12%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	1.451	0,00%	IPCA		16-mai-23	7,04%	7,12%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	581	0,00%	IPCA		10-mai-23	6,83%	6,79%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	581	0,00%	IPCA		16-mai-23	7,04%	7,12%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	290	0,00%	IPCA		19-mai-23	7,42%	7,48%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	290	0,00%	IPCA		31-mai-23	7,42%	7,72%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	290	0,00%	IPCA		31-mai-23	7,64%	7,72%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	104.827	0,09%	IPCA		09-mai-23	5,78%	5,81%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	85.258	0,07%	IPCA		22-mai-23	6,23%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	57.527	0,05%	IPCA		16-mai-23	5,93%	5,96%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	52.037	0,04%	IPCA		03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	51.966	0,04%	IPCA		03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	48.718	0,04%	IPCA		22-mai-23	6,24%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	32.344	0,03%	IPCA		03-mai-23	5,94%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	24.354	0,02%	IPCA		22-mai-23	6,26%	6,33%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	12.994	0,01%	IPCA		03-mai-23	5,95%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	12.419	0,01%	IPCA		31-mai-23	6,36%	6,37%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	2.608	0,00%	IPCA		19-mai-23	6,21%	6,25%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	2.270	0,00%	IPCA		31-mai-23	6,35%	6,37%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.120	0,00%	IPCA		15-mai-23	5,91%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	605	0,00%	IPCA		05-mai-23	5,85%	5,80%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	579	0,00%	IPCA		29-mai-23	6,36%	6,32%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	515	0,00%	IPCA		15-mai-23	5,90%	5,91%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	38.155	0,03%	IPCA		22-mai-23	5,65%	5,74%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	5.680	0,00%	IPCA		16-mai-23	5,44%	5,50%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	598	0,00%	IPCA		10-mai-23	5,50%	5,47%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	299	0,00%	IPCA		15-mai-23	5,46%	5,43%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	299	0,00%	IPCA		31-mai-23	5,44%	5,61%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	299	0,00%	IPCA		31-mai-23	5,63%	5,61%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	54.755	0,05%	IPCA		18-mai-23	5,46%	0,00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	594	0,00%	IPCA		16-mai-23	5,34%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	594	0,00%	IPCA		16-mai-23	5,35%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	297	0,00%	IPCA		31-mai-23	5,38%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	297	0,00%	IPCA		16-mai-23	5,34%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 31/05/2023

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	38.578	0,03%	IPCA	23-mai-23	5,59%	5,58%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	604	0,00%	IPCA	29-mai-23	5,49%	5,49%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	302	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,49%	5,50%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	482.081	0,41%	IPCA	09-mai-23	5,60%	5,64%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	1.221	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,41%	5,49%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	916	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,41%	5,49%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	305	0,00%	IPCA	10-mai-23	5,64%	5,61%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	305	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,41%	5,45%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	612	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,52%	5,59%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	306	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,51%	5,51%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	1.510	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,64%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	604	0,00%	IPCA	10-mai-23	5,89%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	2.423	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,63%	5,67%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	303	0,00%	IPCA	15-mai-23	5,69%	5,63%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	303	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,63%	5,55%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	2.144	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,72%	5,77%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	306	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,67%	5,67%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	2.111	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,80%	5,83%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	302	0,00%	IPCA	15-mai-23	5,84%	5,80%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	392.999	0,34%	IPCA	09-mai-23	5,97%	6,01%	GERI TENAX FI RF LP
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	3.378	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,79%	5,83%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	307	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,72%	5,73%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	307	0,00%	IPCA	15-mai-23	5,84%	5,80%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	307	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,79%	5,73%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	2.127	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,77%	5,82%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	304	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,77%	5,72%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	1.234	0,00%	IPCA	16-mai-23	5,79%	0,00%	ITAÚ GERI RF FI

