

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.160.585,44</b>	<b>100%</b>				<b>1,15%</b>	<b>3,20%</b>	<b>6,40%</b>	<b>5,22%</b>			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.160.585,44</b>	<b>100%</b>			<b>0,02%</b>							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.230.401,31	81,96%	ITAÚ	0,01%	0,03%	1,15%	3,26%	6,58%	5,40%	13,58%	22,81%	25,28%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	930.184,14	18,02%	ITAÚ	0,03%	0,01%	1,28%	3,34%	6,44%	5,15%	14,22%	25,05%	28,79%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
<b>Total</b>	<b>5.161.330,94</b>	<b>100%</b>			<b>0,02%</b>	<b>1,15%</b>	<b>3,20%</b>	<b>6,40%</b>	<b>5,22%</b>			
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%

\* 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.

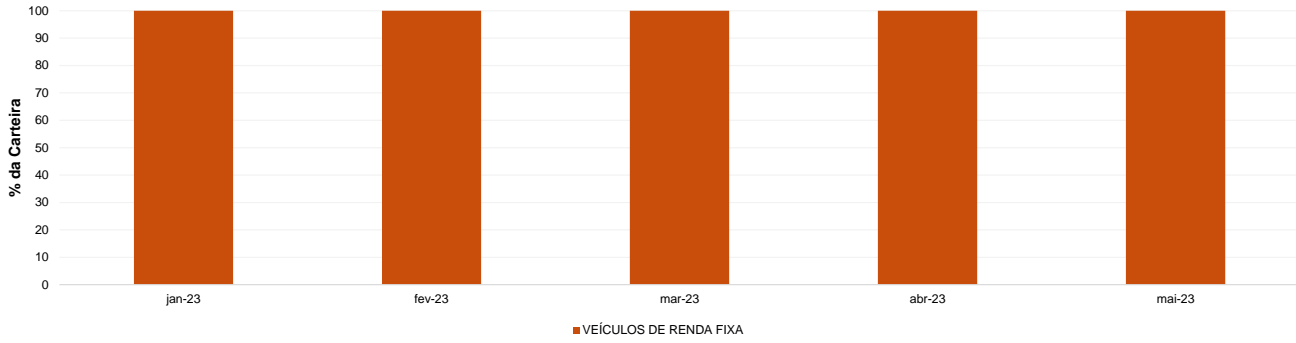
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

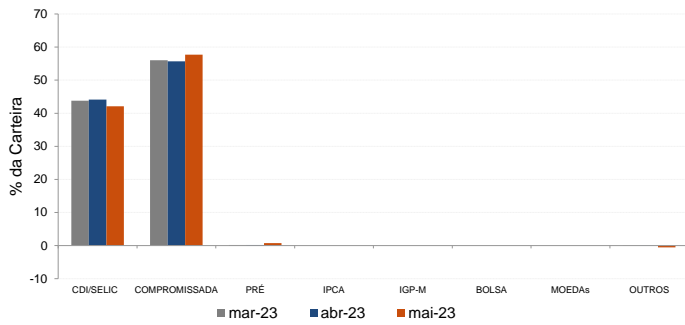
## Distribuição da Carteira

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.

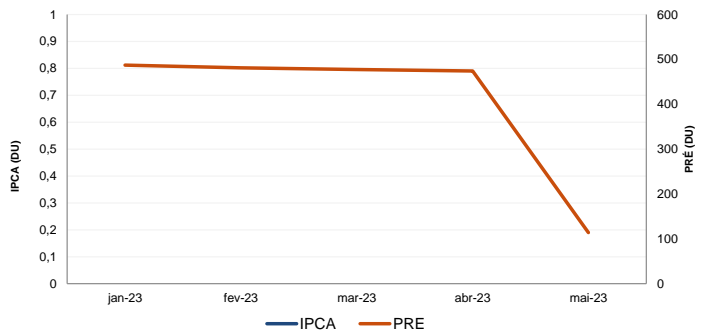
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

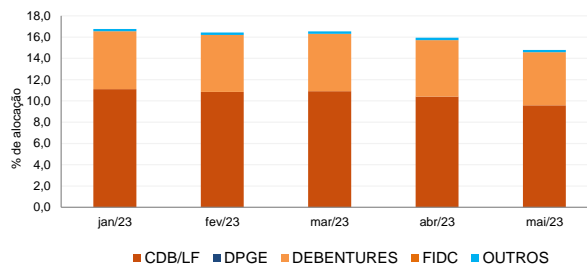
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	126,98	2,46	Faixa 1
BCO ITAU SA	77,98	1,51	Faixa 1
BCO SAFRA SA	63,98	1,24	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	41,98	0,81	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	28,93	0,56	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	26,47	0,51	Faixa 2
BANCO XP S.A	23,46	0,46	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	22,78	0,44	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	18,11	0,35	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	14,89	0,29	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 cheçadas 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: 31/05/2023

## 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
CELG12	20-jan-26	1.405	0,03%	CDI	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	19-mai-23	2,23%	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	1.020	0,02%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	422	0,01%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	339	0,01%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	169	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	34	0,00%	Selic		30-mai-23	0,02%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	25	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	25	0,00%	Selic		25-mai-23	0,01%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	18.527	0,36%	Selic		31-mai-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3.861	0,07%	Selic		31-mai-23	0,01%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	19.970	0,39%	Selic		16-mai-23	0,02%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.170	0,04%	Selic		16-mai-23	0,02%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	22.372	0,43%	Selic		08-mai-23	4,00%	0,04%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	12.305	0,24%	Selic		31-mai-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	7.070	0,14%	Selic		31-mai-23	0,03%	0,03%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	1.723	0,03%	Selic		16-mai-23	0,15%	0,15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	11.121	0,22%	Selic		05-mai-23	0,19%	0,19%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	11.121	0,22%	Selic		05-mai-23	0,19%	0,19%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	6.784	0,13%	Selic		22-mai-23	0,18%	0,18%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	6.105	0,12%	Selic		22-mai-23	0,18%	0,18%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	678	0,01%	Selic		22-mai-23	0,18%	0,18%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-03-01	01-mar-29	3.789	0,07%	Selic		17-mai-23	0,18%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-03-01	01-mar-29	2.526	0,05%	Selic		17-mai-23	0,18%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI

