

## RBSPREV - RBSPREV PLANO CV 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>225.410.541,60</b>	<b>84,96%</b>				<b>1,18%</b>	<b>3,28%</b>	<b>6,22%</b>	<b>5,19%</b>				
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>150.243.068,36</b>	<b>56,63%</b>											
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF RAI	150.243.068,36	56,63%		100%	0,08%	1,07%	3,18%	6,60%	5,54%	-	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	
<b>RF CRÉDITO</b>	<b>39.895.603,51</b>	<b>15,04%</b>											
ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI	930.184,14	0,35%	ITAU	0,03%	0,01%	1,28%	3,34%	6,44%	5,15%	14,22%	25,05%	28,79%	
PENSION FI RF CRED PRIV	15.384.206,29	5,80%	SAFRA	16,83%	0,01%	1,22%	3,24%	6,52%	5,18%	14,58%	28,65%	-	
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	10.637.314,92	4,01%	ARX	5,26%	0,03%	1,26%	2,55%	4,10%	2,83%	-	-	-	
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	1.515.532,07	0,57%	AUGME	0,78%	0,22%	1,10%	2,95%	2,12%	0,81%	9,54%	22,69%	31,59%	
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	10.413.157,23	3,92%	CAPITANIA CAPITAL	11,93%	0,22%	1,28%	2,41%	2,70%	1,47%	9,92%	22,55%	-	
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	1.015.208,86	0,38%	CAPTALYS	0,12%	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>21.930.407,65</b>	<b>8,27%</b>											
BRAM FI RF REF. DI FEDERAL II	1.200.331,01	0,45%	BRABESCO	0,04%	0,03%	1,14%	3,24%	6,55%	5,36%	13,56%	22,71%	25,05%	
ITAU VERSO A RF REF. DI FI	4.230.401,31	1,59%	ITAU	0,01%	0,03%	1,15%	3,26%	6,58%	5,40%	13,58%	22,81%	25,28%	
BRABESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA	10.387.485,64	3,92%	BRABESCO	0,10%	0,03%	1,11%	3,17%	6,41%	5,25%	13,20%	21,97%	24,14%	
GERI TENAX FI RF LP	3.059.747,64	1,15%	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	1,15%	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>12.433.204,14</b>	<b>4,69%</b>											
ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	12.433.204,14	4,69%	ITAU	0,75%	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>908.257,95</b>	<b>0,34%</b>											
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	40.336,63	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	133.786,50	0,05%	AVANTGARDE	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	734.134,82	0,28%	OLIVEIRA TRUST	0,00%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%	
<b>Renda Variável</b>	<b>5.545.073,82</b>	<b>2,09%</b>				<b>5,37%</b>	<b>3,85%</b>	<b>-4,04%</b>	<b>-0,86%</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>0,81%</b>											
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	914.509,21	0,34%	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	0,17%	BOGARI	4,18%	16,31%	11,79%	5,74%	-6,19%	-1,61%	-14,60%	-	-	
KIRON INSTIT. FIA	414.898,13	0,16%	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	0,13%	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>0,56%</b>											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.488.098,88	0,56%	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>0,35%</b>											
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	295.112,54	0,11%	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	0,13%	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	0,11%	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>0,21%</b>											
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	552.015,06	0,21%	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>0,17%</b>											
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	460.498,96	0,17%	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>-30.661,05</b>	<b>-0,01%</b>											
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RV RAI	-30.661,05	-0,01%		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>28.066.732,73</b>	<b>10,58%</b>				<b>1,30%</b>	<b>2,82%</b>	<b>3,98%</b>	<b>3,65%</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 PLANO CV 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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>MM MACRO</b>	<b>15.838.419,13</b>	<b>5,97%</b>										
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	4.981.296,03	1,88%	ITAÚ	1,63%	1,99%	-1,01%	0,66%	2,43%	1,66%	8,59%	21,66%	-
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIEMEN	4.243.452,71	1,60%	ITAÚ	3,16%	1,16%	0,34%	1,55%	4,93%	3,66%	13,59%	36,86%	-
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	317.144,60	0,12%	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	0,31%	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	0,04%	CLAVE	0,02%	2,04%	0,83%	2,43%	7,28%	3,93%	13,28%	-	-
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1.179.330,01	0,44%	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	0,31%	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	0,22%	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	0,16%	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	0,22%	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	0,27%	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	0,20%	VISTA	0,11%	1,38%	1,29%	-0,13%	-0,72%	-0,52%	-6,20%	-	-
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	556.574,75	0,21%	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>12.228.313,60</b>	<b>4,61%</b>										
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	7.649.980,21	2,88%	ITAÚ	1,63%	1,50%	1,01%	0,02%	3,63%	2,24%	10,44%	-	-
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4.578.333,39	1,73%	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>2,41%</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>2,06%</b>										
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	568.355,89	0,21%	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	1,84%	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>0,35%</b>										
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	936.231,66	0,35%	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>265.304.377,75</b>	<b>100%</b>			<b>0,54%</b>	<b>1,28%</b>	<b>3,20%</b>	<b>5,48%</b>	<b>4,72%</b>	<b>11,06%</b>	<b>18,45%</b>	<b>26,65%</b>
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					0,61%	2,65%	5,82%	4,78%	8,48%	26,53%	42,70%

\* 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.

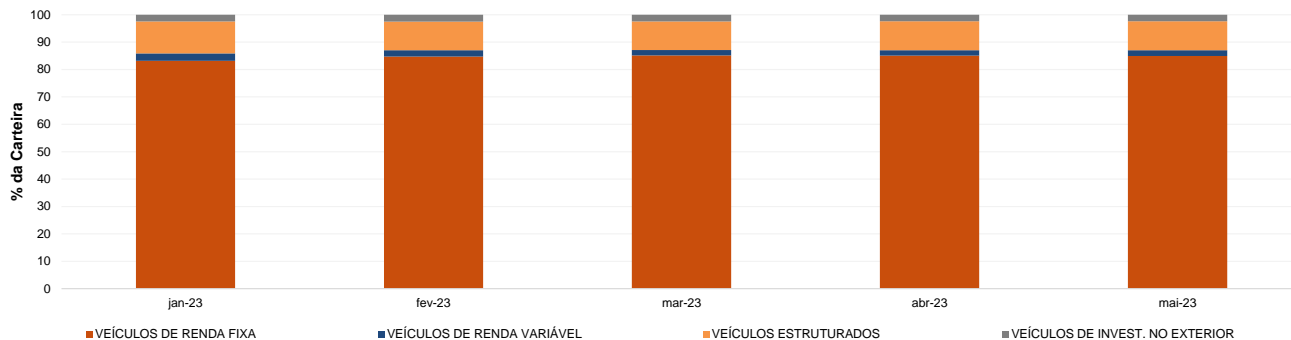
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

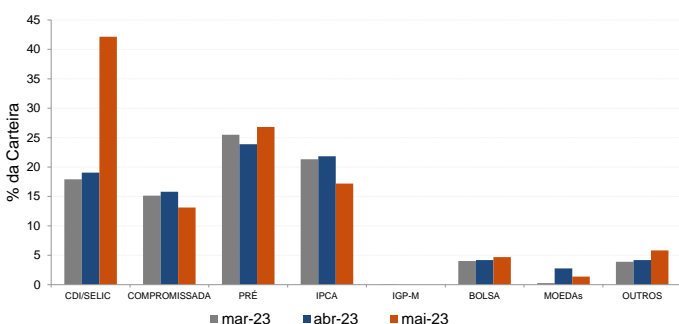
## Distribuição da Carteira

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.

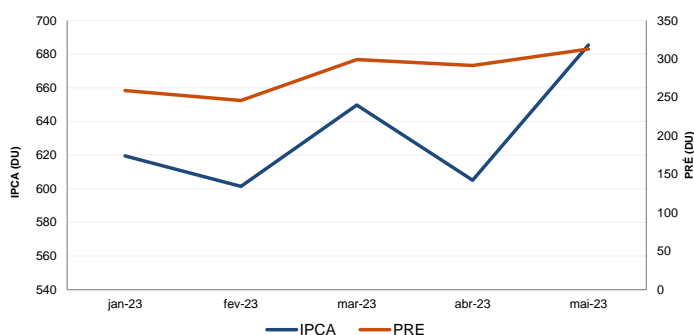
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
IDTP LN		955,05	6,94	948,21	7,02
EQTL3	Energia Elétrica	542,86	3,95	596,15	4,42
ENGI11	Energia Elétrica	460,89	3,35	453,22	3,36
IGTI11	Exploração de Imóveis	455,53	3,31	495,41	3,67
VALE3	Mineração	444,64	3,23	523,02	3,87
ALSO3	Exploração de Imóveis	421,82	3,07	417,11	3,09
ELET3	Energia Elétrica	409,84	2,98	427,73	3,17
ITUB4	Intermediários Financeiros	399,45	2,90	424,36	3,14
SBSP3	Água e Saneamento	373,73	2,72	370,39	2,74
CPFE3	Energia Elétrica	316,72	2,30	320,48	2,37

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

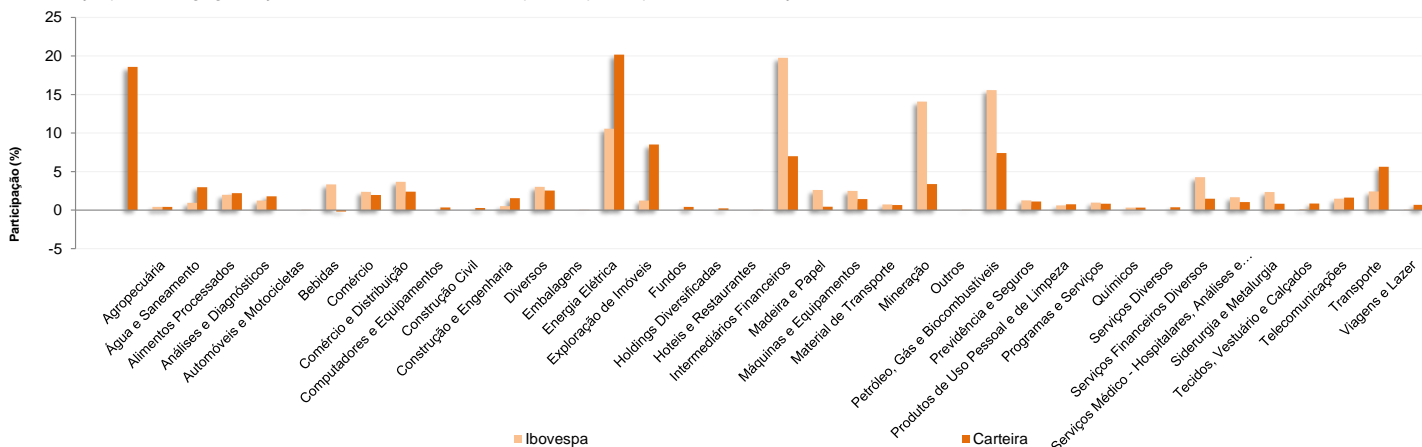
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	4,08	0,03	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	33,03	0,24	0,44	25
MTSA4	43,92	0,32	0,05	3
EQTL3	542,86	3,95	0,00	1
ENGI11	460,89	3,35	0,01	1
IGTI11	455,53	3,31	0,00	1
VALE3	444,64	3,23	0,00	1
ALSO3	421,82	3,07	0,01	1
ELET3	409,84	2,98	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

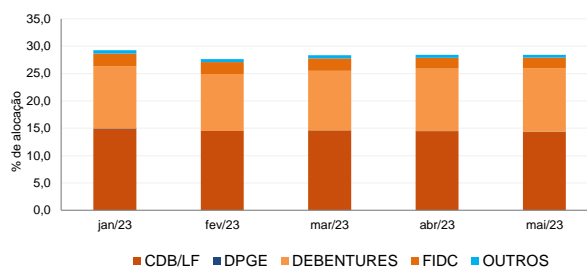
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	10.968,84	4,16	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.810,99	1,82	Faixa 1
BCO ITAU SA	3.475,96	1,32	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.982,62	1,13	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.819,16	0,69	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	1.751,03	0,66	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	1.275,23	0,48	Faixa 2
ENERGISA SA	1.236,17	0,47	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	1.188,19	0,45	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	1.182,46	0,45	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	238,31	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

**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	76.528	0,03%	IPCA	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	31-mai-23	9,43%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ANET12	15-nov-30	208.723	0,08%	IPCA	AMERICA NET S.A.	31-mai-23	10,12%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ARML13	04-nov-29	1.764	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	124.705	0,05%	IPCA	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	09-mai-23	6,12%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CBRDB8	10-mai-28	70.928	0,03%	CDI	COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	30-mai-23	9,90%	Faixa 4	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CELG12	20-jan-26	1.405	0,00%	CDI	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	19-mai-23	2,23%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CSAN24	05-mai-32	8.930	0,00%	CDI	COSAN SA	31-mai-23	2,24%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
DASAC5	30-out-31	42.517	0,02%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	17-mai-23	2,74%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
HBSA12	20-jul-27	9.218	0,00%	CDI	HIDROVIAS BRASIL SA	23-mai-23	3,19%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
HVRD15	15-abr-36	229.945	0,09%	IPCA	BRVIAS HOLDING VRD SA	31-mai-23	8,86%	Faixa 3	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
IOCHB1	15-abr-27	180.262	0,07%	CDI	IOCHPE MAXION SA	11-mai-23	2,50%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	127.122	0,05%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	31-mai-23	8,16%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ITPO14	15-nov-36	107.050	0,04%	IPCA	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	05-mai-23	9,59%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
KLBNA2	19-mar-29	187.321	0,07%	CDI	KLABIN SA	31-mai-23	114,65%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
LF CDI	21-set-26	625.367	0,24%	CDI	ITAÚ UNIBANCO HOLDING SA	31-mai-23	1,83%	Faixa 1	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
LIGHD3	15-out-50	130	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LIGHD3	15-out-50	130	0,00%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	23-mai-23	1,88%	Faixa 8	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
QUAT13	15-jul-34	104.434	0,04%	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	990.902	0,38%	Selic		05-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.020	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	422	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	339	0,00%	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 2023-09-01	01-set-23	3	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	1	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		25-mai-23	0,01%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		25-mai-23	0,01%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		25-mai-23	0,01%	0,02%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		22-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		10-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2023-09-01	01-set-23	0	0,00%	Selic		04-mai-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI















RBSPREV - RBSPREV PLANO CV RAI

Data-base: 31/05/2023

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
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	0,02%	IPCA	18-mai-23	5,46%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	29.484	0,01%	IPCA	18-mai-23	5,46%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
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	16-mai-23	5,34%	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 2028-08-15	15-ago-28	38.578	0,01%	IPCA	23-mai-23	5,59%	5,58%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	21.432	0,01%	IPCA	23-mai-23	5,59%	5,58%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
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	0,18%	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	812.186	0,31%	IPCA	10-mai-23	5,84%	0,00%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
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	524.459	0,20%	IPCA	10-mai-23	5,96%	5,96%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
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	515.482	0,20%	IPCA	10-mai-23	5,96%	5,96%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPR
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	392.999	0,15%	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	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 2050-08-15	15-ago-50	307	0,00%	IPCA	31-mai-23	5,72%	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