

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 30/11/2023

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
Renda Fixa	5,502,725.70	99.97%				0.96%	2.97%	6.47%	12.03%	13.29%		
Benchmark:	CDI					0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%
Renda Fixa	5,502,725.70	99.97%			0.02%							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	3,574,058.69	64.93%	ITAÚ	0.01%	0.02%	0.91%	2.92%	6.37%	12.12%	13.37%	27.12%	32.14%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	1,928,667.01	35.04%	ITAÚ	0.06%	0.03%	1.11%	3.46%	7.65%	13.19%	14.57%	30.13%	36.75%
Benchmark:	CDI					0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%
Total	5,504,413.61	100%			0.02%	0.96%	2.97%	6.47%	12.03%	13.29%		
Benchmark:	CDI					0.92%	2.92%	6.33%	12.04%	13.30%	26.87%	31.66%

* 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.

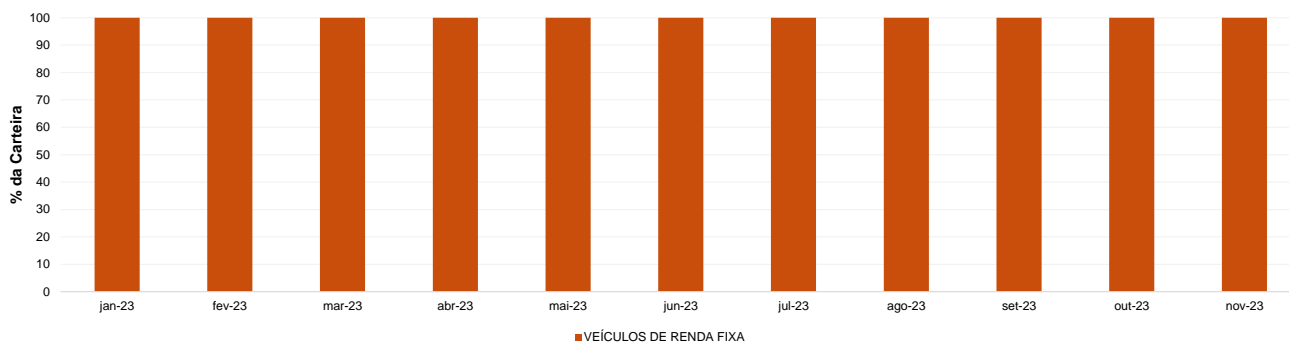
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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

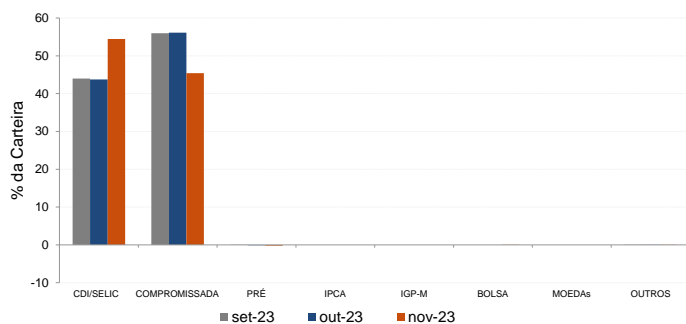
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais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

Evolução do Patrimônio Líquido

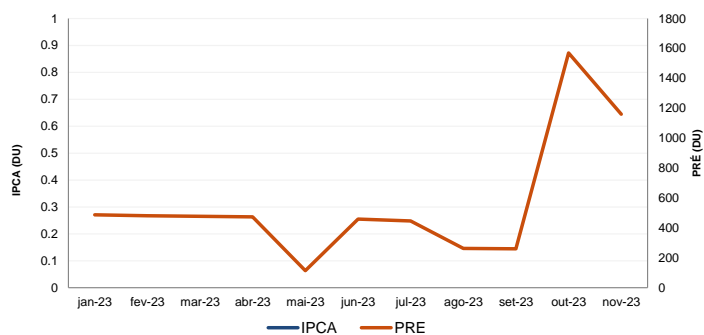


■ VEÍCULOS DE RENDA FIXA

Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 30/11/2023

Análises de Contrapartes

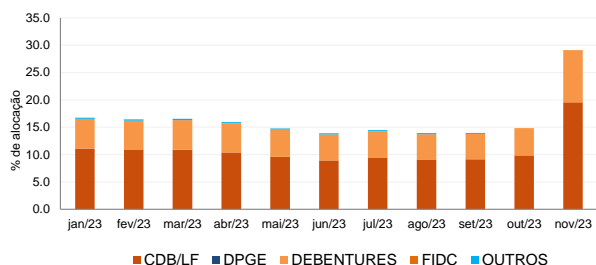
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	277.60	5.08	Faixa 1
BCO ITAU SA	154.65	2.83	Faixa 1
BCO SAFRA SA	145.61	2.67	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	86.16	1.58	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	80.63	1.48	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	51.01	0.93	Faixa 1
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETTRICA P	46.08	0.84	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	43.15	0.79	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	42.82	0.78	Faixa 2
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	33.38	0.61	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 30/11/2023

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
LF CDI	17-nov-25	3,405	0.06%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-nov-23	0.90%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	03-nov-26	1,847	0.03%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	01-nov-23	0.99%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	09-nov-26	9,908	0.18%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	09-nov-23	1.05%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	17-nov-26	3,405	0.06%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	17-nov-23	1.00%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	23-out-28	1,567	0.03%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	17-nov-23	1.40%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Mensal	10-nov-50	2,114	0.04%	CDI	ITAÚ UNIBANCO HOLDING SA	09-nov-23	1.90%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Mensal	10-nov-50	634	0.01%	CDI	ITAÚ UNIBANCO HOLDING SA	09-nov-23	1.90%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
PASS12	01-nov-30	85	0.00%	PRE	COMPASS GÁS E ENERGIA S.A.	01-nov-23	1.55%	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 2024-03-01	01-mar-24	1,908	0.03%	Selic		06-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	759	0.01%	Selic		24-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	509	0.01%	Selic		06-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	379	0.01%	Selic		24-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	254	0.00%	Selic		06-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	63	0.00%	Selic		06-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	949	0.02%	Selic		24-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	31	0.00%	Selic		06-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	12,659	0.23%	Selic		22-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	6,321	0.12%	Selic		27-nov-23	0.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	22,289	0.41%	Selic		23-nov-23	4.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	22,289	0.41%	Selic		30-nov-23	4.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	16,048	0.29%	Selic		29-nov-23	4.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1,783	0.03%	Selic		29-nov-23	4.00%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	17,807	0.33%	Selic		06-nov-23	7.00%	0.08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	8,904	0.16%	Selic		08-nov-23	0.08%	0.08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	6,826	0.12%	Selic		08-nov-23	0.08%	0.08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	6,826	0.12%	Selic		08-nov-23	0.08%	0.08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2,526	0.05%	Selic		29-nov-23	0.12%	0.12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	1,264	0.02%	Selic		27-nov-23	0.12%	0.12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	1,263	0.02%	Selic		28-nov-23	0.12%	0.12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	635	0.01%	Selic		08-nov-23	0.12%	0.12%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	190	0.00%	Selic		17-nov-23	0.14%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	89	0.00%	Selic		08-nov-23	0.14%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	89	0.00%	Selic		08-nov-23	0.14%	0.00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-03-01	01-mar-28	1,269	0.02%	Selic		17-nov-23	0.15%	0.15%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI

