

RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/10/2023

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	5.448.425,70	100%				1,00%	3,20%	6,68%	10,97%	13,41%		
Benchmark:	CDI					1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%
Renda Fixa	5.448.425,70	100%			0,01%							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.458.139,49	81,79%	ITAÚ	0,01%	0,01%	0,99%	3,17%	6,63%	11,10%	13,49%	26,74%	31,10%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	990.286,21	18,17%	ITAÚ	0,03%	0,01%	1,17%	3,79%	7,83%	11,95%	14,61%	29,60%	35,40%
Benchmark:	CDI					1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%
Total	5.450.502,19	100%			0,01%	1,00%	3,20%	6,68%	10,97%	13,39%		
Benchmark:	CDI					1,00%	3,14%	6,55%	11,02%	13,42%	26,45%	30,65%

* 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.

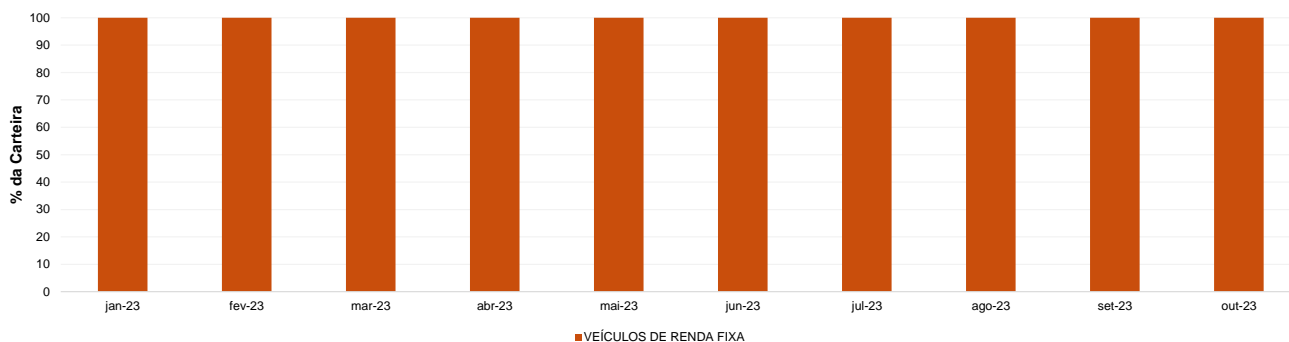
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

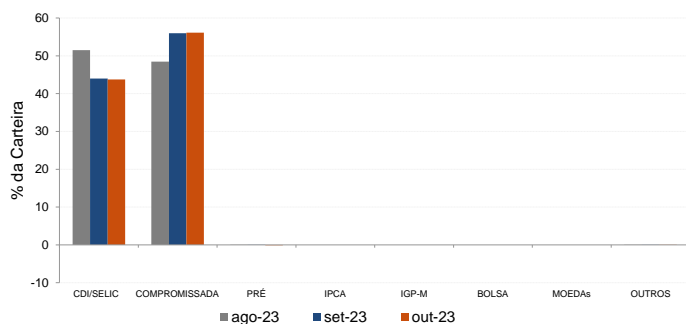
Distribuição da Carteira

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.

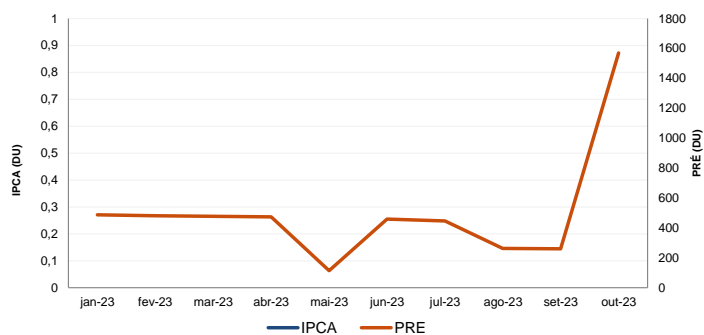
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/10/2023

Análises de Contrapartes

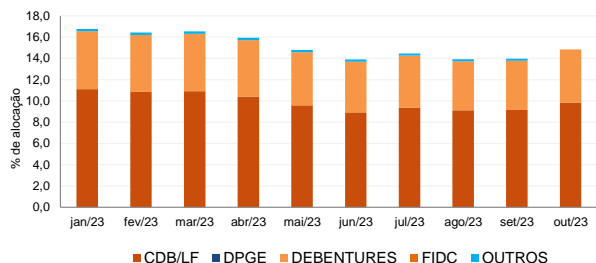
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	141,85	2,61	Faixa 1
BCO ITAU SA	79,07	1,46	Faixa 1
BCO SAFRA SA	74,44	1,37	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	42,63	0,78	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	37,74	0,69	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	25,92	0,48	Faixa 1
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA P	24,50	0,45	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	21,88	0,40	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,79	0,31	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	16,26	0,30	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
PRLG16	2,07	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUB	Sem Faixa	Faixa 2	02-out-28	CDI	2,58%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI



RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 31/10/2023

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
BSA317	11-out-28	4.971	0,09%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	26-out-23	1,05%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CTEE19	15-nov-28	1.032	0,02%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	06-out-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CTEE19	15-nov-28	269	0,00%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	06-out-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CTEE19	15-nov-28	269	0,00%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	06-out-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CTEE19	15-nov-28	269	0,00%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	06-out-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CTEE19	15-nov-28	36	0,00%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE'	06-out-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
IGTA27	20-set-24	629	0,01%	CDI	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTER	18-out-23	0,75%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
IGTA27	20-set-24	315	0,01%	CDI	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTER	18-out-23	0,75%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	22-abr-24	133	0,00%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	31-out-23	0,64%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	06-out-25	67	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	06-out-23	0,90%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-nov-25	986	0,02%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	02-out-23	0,85%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-nov-25	528	0,01%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	23-out-23	0,85%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	05-nov-25	357	0,01%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	26-out-23	0,90%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	06-out-26	656	0,01%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	06-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	23-out-26	155	0,00%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	23-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-out-26	233	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	26-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	29-out-26	1.674	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	30-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-out-26	5.611	0,10%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	30-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-out-26	1.426	0,03%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	30-out-23	1,00%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	26-out-27	776	0,01%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	26-out-23	1,30%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Mensal	10-out-33	9.271	0,17%	CDI	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	10-out-23	1,60%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
PRLG16	02-out-28	2.071	0,04%	CDI	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVI	05-out-23	2,58%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SBSPGO	15-mar-27	317	0,01%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	18-out-23	0,97%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
SBSPHO	15-mar-29	320	0,01%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	18-out-23	1,31%	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	158	0,00%	Selic	11-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	158	0,00%	Selic	25-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	39	0,00%	Selic	11-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	39	0,00%	Selic	25-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.160	0,06%	Selic	24-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.365	0,04%	Selic	30-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.982	0,04%	Selic	11-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-03-01	01-mar-25	17.080	0,31%	Selic	05-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	78	0,00%	Selic	11-out-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	13.239	0,24%	Selic	06-out-23	0,02%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	5.516	0,10%	Selic	27-out-23	0,03%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	789	0,01%	Selic	26-out-23	0,03%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	3.856	0,07%	Selic	06-out-23	6,00%	0,06%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	20.422	0,38%	Selic	05-out-23	0,10%	0,10%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	17.597	0,32%	Selic	05-out-23	0,10%	0,10%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	2.989	0,06%	Selic	06-out-23	0,10%	0,10%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	9.663	0,18%	Selic	06-out-23	0,12%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	317	0,01%	Selic	03-out-23	0,12%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	71	0,00%	Selic	25-out-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2028-09-01	01-set-28	7.887	0,15%	Selic	06-out-23	0,14%	0,14%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-03-01	01-mar-29	2.171	0,04%	Selic	06-out-23	0,15%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	10.930	0,20%	Selic	06-out-23	0,16%	0,16%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI