

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL ULTRA CONSERVADOR

Data-base: 29/09/2023

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>5.394.468,49</b>	<b>100%</b>			<b>0,99%</b>	<b>3,29%</b>	<b>6,55%</b>	<b>9,87%</b>	<b>13,49%</b>		
Benchmark:	CDI				0,97%	3,22%	6,47%	9,93%	13,44%	25,80%	29,57%
<b>Renda Fixa</b>	<b>5.394.468,49</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>							
ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI	4.415.657,03	81,84%	ITAÚ	0,01%	0,99%	3,25%	6,53%	10,02%	13,55%	26,14%	29,99%
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	978.811,46	18,14%	ITAÚ	0,03%	0,00%	1,14%	3,92%	7,52%	10,65%	14,55%	28,93%
Benchmark:	CDI				0,97%	3,22%	6,47%	9,93%	13,44%	25,80%	29,57%
<b>Total</b>	<b>5.395.276,15</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,99%</b>	<b>3,29%</b>	<b>6,55%</b>	<b>9,87%</b>	<b>13,45%</b>		
Benchmark:	CDI				0,97%	3,22%	6,47%	9,93%	13,44%	25,80%	29,57%

\* 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.

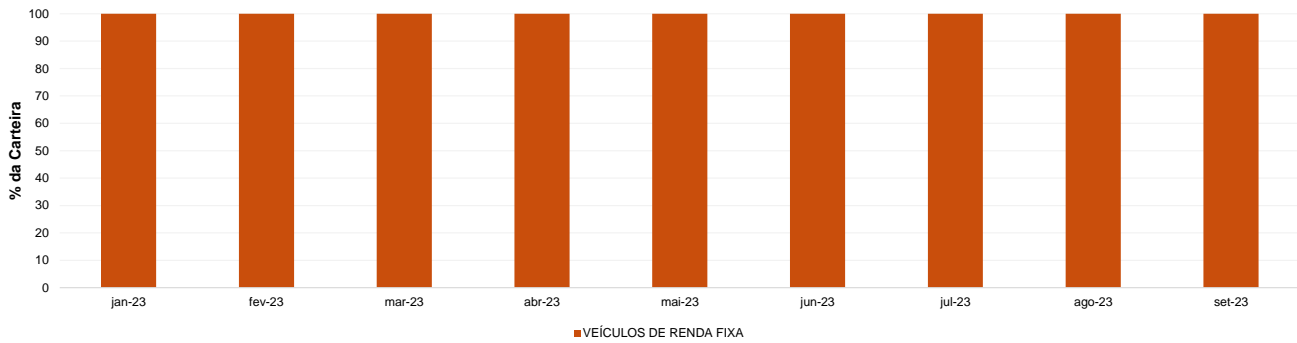
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

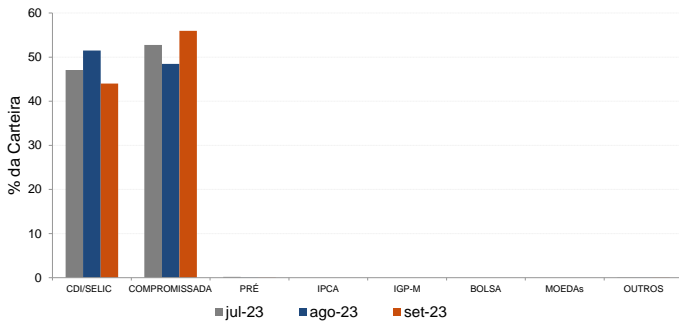
## Distribuição da Carteira

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.

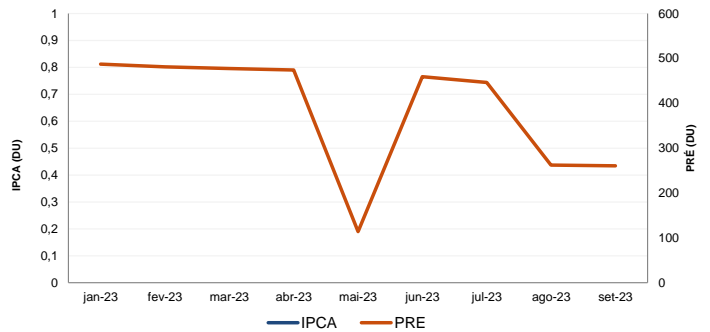
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

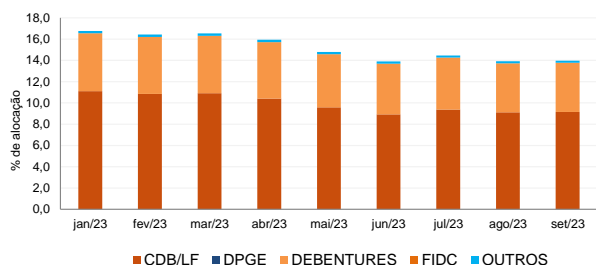
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	134,60	2,50	Faixa 1
BCO ITAU SA	75,07	1,40	Faixa 1
BCO SAFRA SA	70,67	1,31	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,46	0,75	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	35,83	0,67	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	22,43	0,42	Faixa 1
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETTRICA P	21,93	0,41	Faixa 1
BANCO RCI BRASIL SA	20,21	0,38	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	15,94	0,30	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	15,43	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 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
ITSA13	0,02	ITAUSA INVESTS ITAU SA	Faixa 2	Faixa 1	15-dez-30	CDI	1,88%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
ITSA13	0,18	ITAUSA INVESTS ITAU SA	Faixa 2	Faixa 1	15-dez-30	CDI	1,91%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
ITSA13	0,25	ITAUSA INVESTS ITAU SA	Faixa 2	Faixa 1	15-dez-30	CDI	1,93%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
ITSA14	0,93	ITAUSA INVESTS ITAU SA	Faixa 2	Faixa 1	15-jun-27	CDI	1,23%	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI

**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
CAMLB1	30-out-28	316	0,01%	CDI	CAMIL ALIMENTOS SA	20-set-23	1,49%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CCROA6	15-jan-29	309	0,01%	CDI	CCR SA	20-set-23	1,53%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CEEBA4	15-abr-27	331	0,01%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	20-set-23	1,36%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CEPEA2	15-abr-27	331	0,01%	CDI	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	20-set-23	1,71%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CIEL16	20-set-25	374	0,01%	CDI	CIELO SA	20-set-23	1,09%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
CPFPA4	25-mai-29	313	0,01%	CDI	CIA PIRATININGA FORCA LUZ	20-set-23	1,46%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
EEEL18	25-mai-27	313	0,01%	CDI	CIA ESTADUAL GERACAO TRANSMISSAO	20-set-23	1,29%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
EEEL28	25-mai-29	598	0,01%	CDI	CIA ESTADUAL GERACAO TRANSMISSAO	20-set-23	1,47%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
EEEL28	25-mai-29	313	0,01%	CDI	CIA ESTADUAL GERACAO TRANSMISSAO	20-set-23	1,47%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
EKTR29	10-mai-28	499	0,01%	CDI	ELEKTRO REDES SA.	20-set-23	1,64%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
ELET24	15-set-28	1.928	0,04%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	21-set-23	1,55%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
ITSA14	15-jun-27	934	0,02%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	20-set-23	1,23%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	23-out-23	377	0,01%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	19-set-23	0,35%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	14-dez-23	373	0,01%	CDI	BANCO CSF SA	19-set-23	0,56%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	09-abr-24	181	0,00%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	19-set-23	0,69%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	02-mai-24	180	0,00%	CDI	BANCO CSF SA	19-set-23	0,98%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-mai-24	269	0,01%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	19-set-23	0,61%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-set-24	228	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	19-set-23	0,84%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	08-out-24	136	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	19-set-23	0,85%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	14-out-24	343	0,01%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	19-set-23	109,50%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-out-24	378	0,01%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	19-set-23	0,82%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-mar-25	182	0,00%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	19-set-23	0,83%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	14-abr-25	182	0,00%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	19-set-23	110,00%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-abr-25	90	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	19-set-23	1,17%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	28-set-25	410	0,01%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	19-set-23	1,22%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI	30-set-25	3.903	0,07%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	04-set-23	1,05%	Faixa 2	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Semestral	03-out-23	317	0,01%	CDI	BCO JOHN DEERE SA	19-set-23	0,45%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
LF CDI Semestral	23-set-24	149	0,00%	CDI	BCO JOHN DEERE SA	19-set-23	1,01%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
NTSD25	13-set-29	1.200	0,02%	CDI	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA -	20-set-23	1,57%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
TAEAA1	15-mai-28	595	0,01%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	20-set-23	1,41%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
TAEAA1	15-mai-28	318	0,01%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	20-set-23	1,41%	Faixa 1	ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI
XPVS14	23-jun-24	358	0,01%	CDI	XP INVESTIMENTOS S.A.	20-set-23	1,34%	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	39.948	0,74%	Selic	20-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.075	0,04%	Selic	04-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.654	0,03%	Selic	14-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	165	0,00%	Selic	12-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-03-01	01-mar-24	11	0,00%	Selic	21-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	10.050	0,19%	Selic	20-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	11	0,00%	Selic	29-set-23	0,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	34.239	0,64%	Selic	28-set-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.706	0,11%	Selic	28-set-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.706	0,11%	Selic	28-set-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	5.362	0,10%	Selic	28-set-23	0,01%	0,01%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	22.812	0,42%	Selic	28-set-23	4,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	17.109	0,32%	Selic	08-set-23	4,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	11.406	0,21%	Selic	08-set-23	4,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-03-01	01-mar-26	9.866	0,18%	Selic	28-set-23	4,00%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	22.786	0,42%	Selic	06-set-23	7,00%	0,07%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	22.786	0,42%	Selic	21-set-23	0,08%	0,07%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	11.393	0,21%	Selic	21-set-23	0,08%	0,07%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	5.697	0,11%	Selic	20-set-23	0,08%	0,08%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2026-09-01	01-set-26	1.823	0,03%	Selic	06-set-23	7,00%	0,07%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-03-01	01-mar-27	16	0,00%	Selic	28-set-23	0,11%	0,10%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	11.359	0,21%	Selic	14-set-23	0,13%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	9.769	0,18%	Selic	21-set-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	8.179	0,15%	Selic	22-set-23	0,14%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2027-09-01	01-set-27	413	0,01%	Selic	11-set-23	0,13%	0,00%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	5.654	0,11%	Selic	21-set-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI
LFT 2029-09-01	01-set-29	5.654	0,11%	Selic	21-set-23	0,17%	0,17%	ITAÚ VERSO A RF REF. DI FI