

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 30/06/2023

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	85,389,453.31	71.95%				1.27%	3.21%	6.05%	6.05%					
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	55,393,771.08	46.67%												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF	55,393,771.08	46.67%		100%	0.05%	1.25%	2.85%	5.66%	5.66%	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
RF CRÉDITO	19,075,399.51	16.07%												
PENSION FI RF CRED PRIV	8,054,722.29	6.79%	SAFRA	8.71%	0.00%	1.19%	3.33%	6.43%	6.43%	14.61%	29.49%	-		
ARX VINSON INSTIT. FIC FI RF CRED PRIV	7,453,891.23	6.28%	ARX	3.44%	0.03%	1.07%	3.09%	3.93%	3.93%	-	-	-		
AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV	919,231.46	0.77%	AUGME	0.47%	0.17%	1.27%	3.25%	2.09%	2.09%	9.66%	23.41%	32.28%		
CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI RF	2,206,968.18	1.86%	CAPITANIA CAPITAL	2.25%	0.09%	1.15%	2.95%	2.64%	2.64%	10.07%	23.18%	-		
ORION FIC FI MULT - CRED PRIV	440,586.36	0.37%	CAPTALYS	0.05%	0.00%	1.09%	3.43%	-0.78%	-0.78%	-3.64%	6.97%	16.63%		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
RF REFERENCIADO DI	6,245,329.69	5.26%												
GERI TENAX FI RF LP	3,124,032.59	2.63%	TENAX CAPITAL	2.55%	0.61%	2.10%	6.09%	11.42%	11.42%	15.76%	19.54%	23.71%		
ITAÚ GERI RF FI	3,121,297.10	2.63%	ITAÚ	7.05%	0.75%	2.26%	6.19%	10.31%	10.31%	14.17%	10.47%	8.93%		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
RF	4,180,683.97	3.52%												
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	4,180,683.97	3.52%	ITAÚ	0.24%	0.46%	1.66%	4.39%	8.38%	8.38%	13.14%	23.94%	27.95%		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
FIDC	494,269.06	0.42%												
FIDC OPEA AGRO SUMITOMO CHEMICAL - SENIOR	71,303.48	0.06%	AVANTGARDE	0.00%	-	-	-	-	-	-	-	-		
FIDC BANCO EMISSORES CARTAO DE CREDITO STO	404,455.08	0.34%	OLIVEIRA TRUST	0.00%	-	-	-	-	-	-	-	-		
FIDC MULT MAXIMUM-SEN 7	18,510.50	0.02%	BNY MELLON	0.00%	-	-	-	-	-	-	-	-		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		
Renda Variável	6,187,580.15	5.21%				8.86%	17.20%	7.94%	7.94%					
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					9.27%	16.74%	9.19%	9.19%	23.41%	-1.21%	35.72%		
RV VALOR	2,328,280.62	1.96%												
ABSOLUTO PARTNERS INSTIT. FIC FIA	1,012,651.24	0.85%	ABSOLUTO PARTNERS	0.25%	8.77%	10.73%	22.68%	12.20%	12.20%	14.94%	-31.36%	-9.51%		
BOGARI VALUE T INSTIT. FIC FIA	491,399.46	0.41%	BOGARI	4.18%	11.68%	9.11%	23.38%	7.36%	7.36%	6.07%	-	-		
KIRON INSTIT. FIA	447,123.78	0.38%	KIRON CAPITAL	0.84%	8.82%	7.77%	15.86%	4.25%	4.25%	16.99%	-16.37%	3.00%		
LIS VALUE FIA	377,106.14	0.32%	LIS CAPITAL	0.22%	9.76%	5.83%	11.38%	3.49%	3.49%	6.66%	-29.50%	0.78%		
Benchmark:	IBOVESPA					9.00%	15.91%	7.61%	7.61%	19.83%	-6.87%	24.23%		
CARTEIRA PRÓPRIA RV	1,738,954.94	1.47%												
RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RV	1,738,954.94	1.47%		100%	15.64%	8.90%	15.92%	7.76%	7.76%	-	-	-		
Benchmark:	IBX					8.87%	14.96%	6.59%	6.59%	17.60%	-9.50%	23.38%		
RV ATIVO	1,024,311.68	0.86%												
OCEANA VALOR 30 FIC FIA	321,036.17	0.27%	OCEANA	0.07%	6.80%	8.78%	17.25%	9.43%	9.43%	21.55%	0.17%	34.46%		
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	374,450.23	0.32%	AZ QUEST	0.14%	12.01%	9.93%	14.56%	5.78%	5.78%	13.83%	-18.28%	2.90%		
XP INVESTOR FIA	328,825.28	0.28%	XP	0.15%	7.25%	8.43%	17.61%	12.55%	12.55%	20.29%	-2.51%	23.95%		
Benchmark:	IBOVESPA					9.00%	15.91%	7.61%	7.61%	19.83%	-6.87%	24.23%		
RV SMALL CAP	601,487.62	0.51%												
AZ QUEST S.M.CAPS. FIC FIA	601,487.62	0.51%	AZ QUEST	0.07%	12.67%	8.96%	15.93%	9.59%	9.59%	13.67%	-20.21%	9.78%		
Benchmark:	SMLL					8.17%	25.16%	13.26%	13.26%	19.79%	-27.64%	1.04%		
RV LONG BIAS	494,545.28	0.42%												
SHARP LONG BIASED FIC FI MULT	494,545.28	0.42%	SHARP	0.91%	3.52%	7.39%	13.10%	8.55%	8.55%	23.62%	10.45%	-		
Benchmark:	IBOVESPA					9.00%	15.91%	7.61%	7.61%	19.83%	-6.87%	24.23%		
Estruturado	21,078,016.61	17.76%				2.75%	5.99%	7.20%	7.20%					
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					1.32%	3.89%	8.06%	8.06%	16.94%	30.87%	37.84%		
MM MACRO	13,452,291.63	11.33%												
ITAÚ INSTIT. OPTIMUS TITAN MULT FIC FIIMEN	4,313,942.85	3.63%	ITAÚ	2.51%	1.41%	1.66%	2.82%	5.38%	5.38%	13.82%	38.97%	-		
ITAÚ INSTIT. MACRO OPPORT MULT FICFI	2,475,845.30	2.09%	ITAÚ	0.81%	1.97%	0.90%	0.24%	2.58%	2.58%	8.33%	23.25%	29.61%		
IBIUNA HEDGE STH FIC FI MULT	324,151.48	0.27%	IBIUNA	0.01%	2.07%	2.21%	3.62%	1.92%	1.92%	7.12%	28.82%	40.56%		
SOLANA EQ.HEDG. VIII FIC FI MULT	810,372.89	0.68%	SOLANA	1.23%	4.84%	-0.27%	2.42%	-1.39%	-1.39%	11.32%	7.93%	-		
CLAVE ALPHA MACRO II FIC FI MULT	102,108.57	0.09%	CLAVE	0.02%	2.21%	0.49%	2.14%	4.44%	4.44%	14.62%	-	-		
F35 LIGHTNING FIC FI MULT	1,139,636.07	0.96%	SPX	1.71%	2.65%	-3.37%	-3.80%	-2.31%	-2.31%	-2.43%	23.58%	36.25%		
GENOA TL FIC FI MULT	826,466.21	0.70%	GENOA	0.61%	1.28%	1.50%	4.29%	8.32%	8.32%	18.08%	37.71%	-		
KAPITALO ZETA FIC FI MULT	585,067.21	0.49%	KAPITALO	0.03%	13.61%	-1.24%	-2.55%	0.21%	0.21%	9.66%	24.63%	48.91%		
KAPITALO NW3 PLUS FIC FI MULT	424,055.30	0.36%	NW3	0.18%	3.21%	1.88%	0.66%	1.33%	1.33%	9.88%	20.89%	27.70%		
RPS TOTAL RETURN FIC FI MULT D30 TAG	606,502.96	0.51%	RPS CAPITAL	1.89%	7.38%	3.39%	10.53%	6.54%	6.54%	8.24%	7.64%	25.31%		
CLAVE ALPHA MACRO FIC FI MULT	718,148.64	0.61%	CLAVE	0.26%	2.21%	0.49%	2.14%	4.44%	4.44%	14.60%	25.86%	48.29%		
VISTA HEDGE D30 FIC FI MULT	538,048.39	0.45%	VISTA	0.12%	2.36%	3.02%	4.41%	2.48%	2.48%	-2.10%	-	-		
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	587,945.76	0.50%	ZEITGEIST	0.04%	3.23%	5.64%	8.00%	6.42%	6.42%	7.07%	23.29%	26.59%		
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%		

* 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 PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 30/06/2023

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	
MM FIC	7,625,724.98	6.43%											
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO ULTRA MULT FIC FI	2,676,657.21	2.26%	ITAÚ	0.56%	1.18%	1.97%	3.51%	4.25%	4.25%	10.98%	-	-	
ITAÚ INFLATION EQUITY OPPORT MULT FICFI	4,949,067.77	4.17%	ITAÚ	1.12%	6.02%	8.10%	20.05%	21.07%	21.07%	27.72%	12.45%	-	
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
Exterior	6,097,632.62	5.14%				-4.57%	-4.78%	-6.12%	-6.12%				
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0.18%	0.82%	5.28%	5.28%	7.20%	-5.27%	18.58%	
MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5,220,297.63	4.40%											
CARTEIRA ITAU ASSET INTER INSTIT. FICFI MULT IE	549,600.34	0.46%	ITAÚ	1.15%	2.68%	-3.30%	-3.90%	-2.98%	-2.98%	-1.39%	-10.22%	-	
TAG MULTI ASSETS SOLUTION FI MULT IE	4,670,697.29	3.94%	TAG INVEST	12.96%	2.38%	-4.39%	-4.42%	-6.38%	-6.38%	-3.51%	-11.64%	-	
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
RF INVESTIMENTO NO EXTERIOR	877,334.99	0.74%											
ITAÚ INFLA AMERICANA RF IE FIC FI	877,334.99	0.74%	ITAÚ	2.73%	3.04%	-6.29%	-7.15%	-7.87%	-7.87%	-10.31%	-11.30%	-13.87%	
Benchmark:	CDI					1.07%	3.15%	6.50%	6.50%	13.54%	23.37%	26.17%	
Total	118,682,687.03	100%				1.36%	1.88%	4.40%	6.45%	6.45%	11.91%	16.90%	24.08%
Benchmark:	IPCA + 8.1% a.a.					0.57%	2.68%	6.89%	6.89%	11.48%	34.84%	57.88%	

* 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.

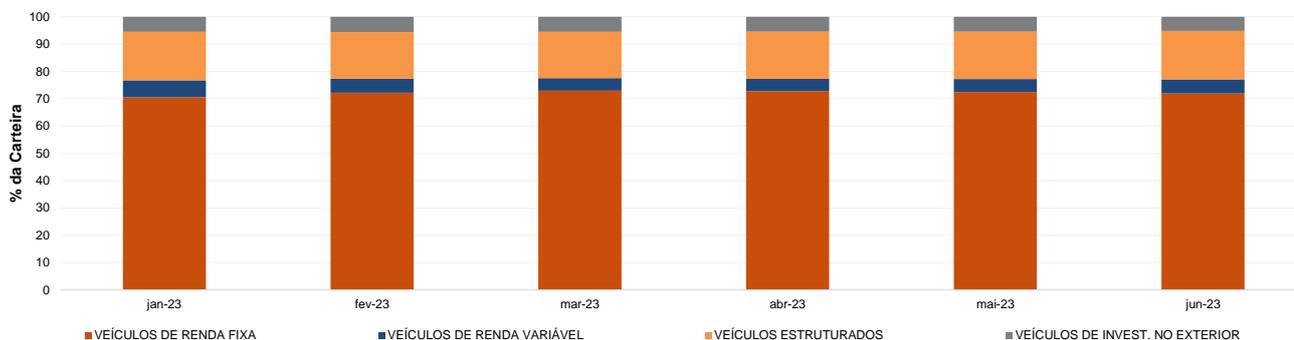
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

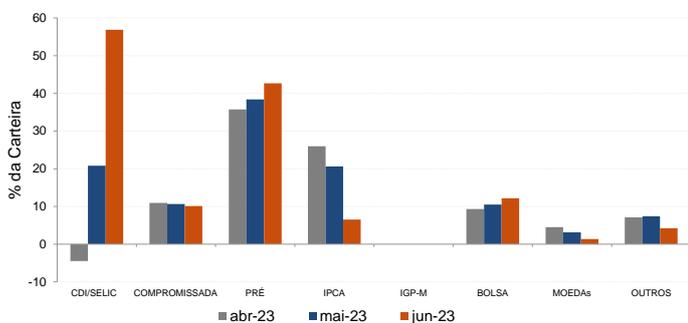
Distribuição da Carteira

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.

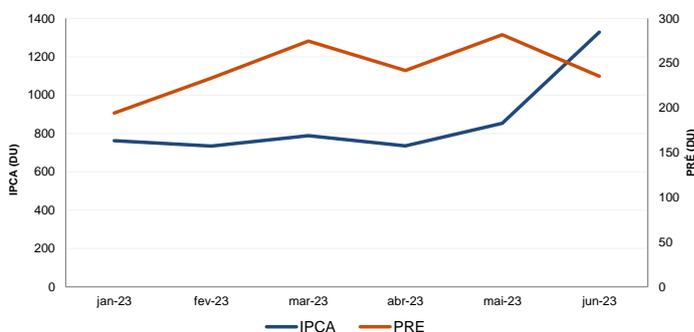
Evolução do Patrimônio Líquido



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		897.73	6.13	955.05	7.34
ELET3	Energia Elétrica	519.80	3.55	373.03	2.87
EQTL3	Energia Elétrica	519.67	3.55	494.74	3.80
VALE3	Mineração	518.82	3.54	374.86	2.88
IGTI11	Exploração de Imóveis	518.59	3.54	452.61	3.48
ENGI11	Energia Elétrica	512.36	3.50	450.36	3.46
ITUB4	Intermediários Financeiros	408.24	2.79	351.77	2.70
RAIL3	Transporte	377.55	2.58	290.33	2.23
RENT3	Diversos	362.30	2.47	292.25	2.25
SBSP3	Água e Saneamento	359.94	2.46	358.77	2.76

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

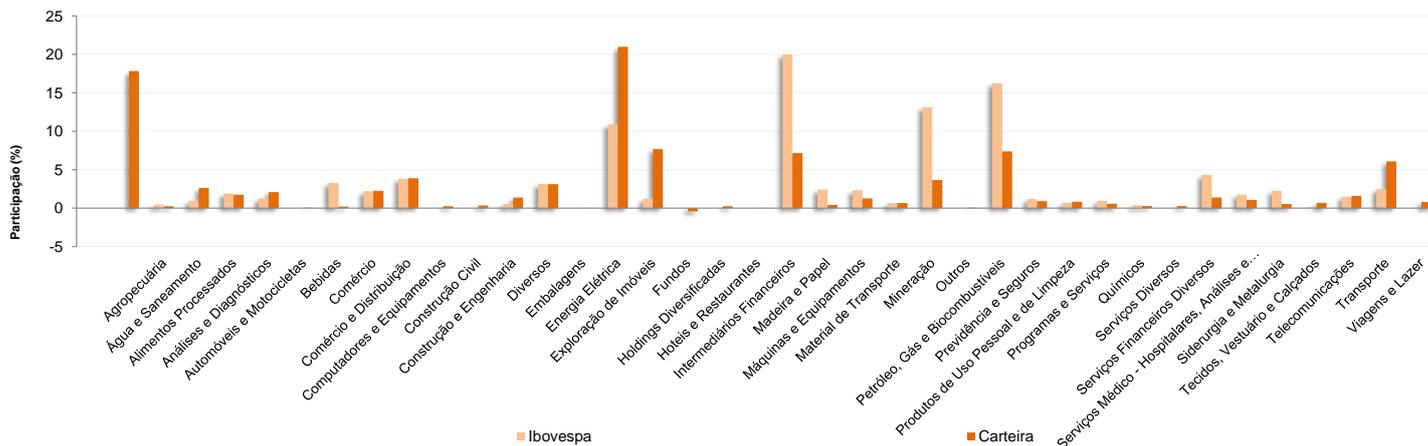
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	3.60	0.02	0.00	Sem Liquidez
GETT11	0.02	0.00	0.00	Sem Liquidez
BAUH4	33.29	0.23	0.45	3
MTSA4	49.75	0.34	0.05	2
SCAR3	26.49	0.18	0.01	2
ELET3	519.80	3.55	0.00	1
EQTL3	519.67	3.55	0.00	1
VALE3	518.82	3.54	0.00	1
IGTI11	518.59	3.54	0.00	1
ENGI11	512.36	3.50	0.01	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

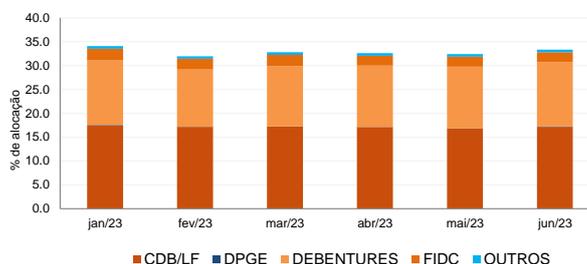
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6,636.15	5.69	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2,786.58	2.39	Faixa 1
BCO ITAU SA	1,560.10	1.34	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1,520.78	1.30	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	989.05	0.85	Faixa 1
ENERGISA SA	962.91	0.83	Faixa 2
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	913.55	0.78	Faixa 1
CENTRAIS ELÉTRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	814.94	0.70	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	813.63	0.70	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	738.69	0.63	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
CPLD28	41.34	COPEL DISTRIBUICAO SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-jun-27	CDI	2.16%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
CPLD28	196.12	COPEL DISTRIBUICAO SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-jun-27	CDI	2.09%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF
CPLD38	85.52	COPEL DISTRIBUICAO SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-jun-28	CDI	2.25%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP RF
CSAN16	8.52	COSAN SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-28	CDI	2.40%	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
ENEV19	3.82	ENEVA S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-set-32	IPCA	7.64%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
ENEV19	5.44	ENEVA S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-set-32	IPCA	7.64%	CAPITÂNIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
ERDVA2	25.23	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-26	CDI	2.73%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
ERDVA2	-0.59	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-26	CDI	2.68%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
IRJS12	6.50	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	Faixa 3	Faixa 2	31-jul-25	CDI	4.03%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	52.69	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	2.12%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	0.14	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	0.16	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	0.63	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	1.32	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	2.64	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	3.22	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	7.27	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.89%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	7.89	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.92%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
UGEL11	2.54	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 2	Faixa 5	08-abr-27	CDI	17.92%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO RAI

Data-base: 30/06/2023

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
ANHBA4	14-jun-28	22,825	0.02%	CDI	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUEF	16-jun-23	2.19%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
ANHBA4	14-jun-28	18,726	0.02%	CDI	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUEF	16-jun-23	2.19%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
ARTRA1	11-mar-27	32,212	0.03%	CDI	ARTERIS SA	27-jun-23	2.44%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
CDB CDI	26-jun-25	87,195	0.07%	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	26-jun-23	1.32%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
CPLD28	15-jun-27	196,123	0.17%	CDI	COPEL DISTRIBUICAO SA	20-jun-23	2.09%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
CPLD38	15-jun-28	85,523	0.07%	CDI	COPEL DISTRIBUICAO SA	20-jun-23	2.25%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
CSAN16	20-jun-28	8,521	0.01%	CDI	COSAN SA	30-jun-23	2.40%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
CSNAA2	20-dez-27	16,997	0.01%	CDI	CIA SIDERURGICA NACIONAL	27-jun-23	3.34%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ELET13	15-abr-26	15,893	0.01%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	27-jun-23	1.83%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ENEV48	15-jul-32	25,752	0.02%	CDI	ENEVA S.A	05-jun-23	2.30%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
ENGIC5	15-out-28	36,364	0.03%	CDI	ENERGISA SA	30-jun-23	1.87%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LF CDI	30-abr-26	100,400	0.09%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	21-jun-23	1.60%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	15-jun-26	50,312	0.04%	CDI	BCO GMAC SA	15-jun-23	1.45%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	19-jun-26	100,453	0.09%	CDI	BCO GMAC SA	20-jun-23	1.45%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	03-dez-26	50,173	0.04%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	22-jun-23	1.70%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	01-jun-27	50,174	0.04%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	22-jun-23	1.80%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LF CDI	22-jun-27	50,144	0.04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-jun-23	1.70%	Faixa 1	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
MTRJ19	15-dez-31	15,262	0.01%	IPCA	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIR	06-jun-23	8.41%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
MTRO12	25-abr-27	35,527	0.03%	CDI	CIA METROPOLITANO SAO PAULO METR	30-jun-23	40.19%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
MVLV26	15-dez-25	9,751	0.01%	IPCA	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	19-jun-23	9.00%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
OMGE41	15-mai-27	22,809	0.02%	IPCA	OMEGA GERACAO SA	05-jun-23	7.04%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RDCO19	15-jun-25	33,745	0.03%	CDI	RODOVIAS COLINAS SA	30-jun-23	1.98%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RDOB9	20-ago-31	4,833	0.00%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	29-jun-23	2.16%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
RDOB9	20-ago-31	1,185	0.00%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	30-jun-23	2.16%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
RMSA12	15-jun-42	29,500	0.03%	IPCA	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLIT	05-jun-23	7.94%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
RODB11	10-mai-30	2,950	0.00%	CDI	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	09-jun-23	3.46%	Faixa 2	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
SBSPF8	15-jul-28	88,299	0.08%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST	09-jun-23	1.62%	Faixa 1	PENSION FI RF CRED PRIV
SNGO10	15-jun-27	90,570	0.08%	CDI	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	20-jun-23	1.81%	Faixa 2	PENSION FI RF CRED PRIV
SULA29	08-nov-28	4,894	0.00%	CDI	SUL AMERICA SA	29-jun-23	2.13%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
SULA29	08-nov-28	578	0.00%	CDI	SUL AMERICA SA	29-jun-23	2.14%	Faixa 1	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
TIET19	15-mar-27	33,773	0.03%	CDI	AES TIETE ENERGIA SA	30-jun-23	1.71%	Faixa 2	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
USIM28	23-mai-29	37,152	0.03%	CDI	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS S	30-jun-23	2.23%	Faixa 1	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-09-01	01-set-24	63,507	0.05%	Selic		09-jun-23	0.01%	0.00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	3,791	0.00%	Selic		06-jun-23	0.01%	0.00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2024-09-01	01-set-24	2,844	0.00%	Selic		20-jun-23	0.01%	0.00%	ITAÚ GERI RF FI
LFT 2025-09-01	01-set-25	1,760,589	1.51%	Selic		12-jun-23	0.03%	0.03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-09-01	01-set-25	241,913	0.21%	Selic		06-jun-23	0.03%	0.03%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2025-09-01	01-set-25	3,025	0.00%	Selic		16-jun-23	0.02%	0.02%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV F
LFT 2027-03-01	01-mar-27	388,075	0.33%	Selic		09-jun-23	0.14%	0.14%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2027-09-01	01-set-27	3,796,550	3.26%	Selic		15-jun-23	0.15%	0.00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
LFT 2027-09-01	01-set-27	53,473	0.05%	Selic		16-jun-23	0.15%	0.00%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	293	0.00%	IPCA		26-jun-23	7.36%	7.46%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	98,984	0.08%	IPCA		26-jun-23	6.13%	6.17%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	44,641	0.04%	IPCA		23-jun-23	6.19%	6.15%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	44,330	0.04%	IPCA		07-jun-23	6.20%	6.35%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	31,545	0.03%	IPCA		23-jun-23	6.20%	6.15%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	23,651	0.02%	IPCA		23-jun-23	6.21%	6.15%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	23,651	0.02%	IPCA		23-jun-23	6.21%	6.15%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	23,169	0.02%	IPCA		02-jun-23	6.29%	6.31%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	18,379	0.02%	IPCA		05-jun-23	6.24%	6.21%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	16,862	0.01%	IPCA		26-jun-23	6.13%	6.17%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	16,752	0.01%	IPCA		06-jun-23	6.17%	6.26%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	12,554	0.01%	IPCA		16-jun-23	6.32%	6.29%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	9,531	0.01%	IPCA		01-jun-23	6.33%	6.34%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	8,928	0.01%	IPCA		23-jun-23	6.21%	6.15%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	8,054	0.01%	IPCA		01-jun-23	6.34%	6.34%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	7,452	0.01%	IPCA		27-jun-23	6.15%	6.12%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	7,251	0.01%	IPCA		07-jun-23	6.19%	6.35%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	2,069	0.00%	IPCA		06-jun-23	6.16%	6.26%	ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	293	0.00%	IPCA		01-jun-23	6.34%	6.34%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	293	0.00%	IPCA		06-jun-23	6.16%	6.26%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	293	0.00%	IPCA		26-jun-23	6.13%	6.17%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	604	0.00%	IPCA		16-jun-23	5.63%	5.62%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	302	0.00%	IPCA		06-jun-23	5.45%	5.51%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	302	0.00%	IPCA		27-jun-23	5.53%	5.51%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	13,080	0.01%	IPCA		27-jun-23	5.32%	5.32%	RBSPREV PERFIL MODERADO RAI CP F
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	2,459	0.00%	IPCA		16-jun-23	5.45%	5.44%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	366	0.00%	IPCA		01-jun-23	5.46%	5.47%	AUGME INSTIT. FI RF CRED PRIV
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	312	0.00%	IPCA		26-jun-23	5.23%	5.24%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	1,244	0.00%	IPCA		16-jun-23	5.49%	0.00%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	318	0.00%	IPCA		16-jun-23	5.55%	5.53%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	320	0.00%	IPCA		27-jun-23	5.57%	5.59%	ITAÚ GERI RF FI
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	323	0.00%	IPCA		16-jun-23	5.62%	0.00%	ITAÚ GERI RF FI