

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

Data-base: 30/04/2021

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	250.223.384,38	96,53%				0,28%	0,62%	2,61%	0,81%	4,75%	10,46%	18,23%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,39%	2,36%	5,18%	2,70%	7,82%	11,51%	18,18%
Renda Fixa Total Return	241.901.313,86	93,32%			0,82%	0,26%	0,53%	2,47%	0,69%	4,54%	10,17%	18,17%
ATLANTIDA FI MULT	47.428.507,93	18,30%	ITAU	100%	1,12%	0,37%	0,82%	3,04%	1,01%	5,24%	12,26%	21,75%
ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO MM	73.831.847,55	28,48%	ITAU	100%	1,81%	-	-	-	-	-	-	-
ITAPEMA FI MULT	64.873.968,67	25,03%	SUL AMERICA	100%	0,13%	0,16%	0,23%	1,85%	0,34%	3,78%	7,98%	14,73%
ITAPEMA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO MM	55.766.989,72	21,51%	TAG INVEST	100%	0,11%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,39%	2,36%	5,18%	2,70%	7,82%	11,51%	18,18%
Renda Fixa ALM	6.158.075,56	2,38%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.158.075,56	2,38%		100%		1,03%	3,68%	8,37%	5,12%	13,53%	24,79%	39,31%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,65%	3,18%	6,89%	3,79%	11,41%	19,11%	30,44%
Renda Fixa CDI	2.163.994,96	0,83%			0,07%	0,14%	0,62%	1,29%	0,90%	2,69%	5,13%	12,57%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.545.793,27	0,60%	BRADESCO	0,02%	0,06%	0,14%	0,44%	0,95%	0,60%	1,85%	7,07%	13,81%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	618.201,69	0,24%	ITAU	0,00%	0,07%	0,13%	0,39%	0,89%	0,56%	1,79%	6,91%	13,52%
Benchmark:	CDI					0,21%	0,54%	1,01%	0,69%	2,15%	7,46%	14,28%
Renda Variável	4.632.354,86	1,79%				3,09%	2,41%	18,63%	1,09%	46,37%	24,36%	43,63%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					2,18%	4,07%	28,39%	0,85%	52,08%	30,89%	50,81%
Renda Variável Ativa	4.632.354,86	1,79%			7,32%	3,09%	2,41%	18,63%	1,09%	46,37%	24,36%	43,90%
ITAU ACOES DUNAMIS INSTITUCIONAL FC	4.632.354,86	1,79%	ITAU	2,02%	7,32%	3,14%	5,81%	24,98%	4,25%	47,13%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					2,18%	4,07%	28,39%	0,85%	52,08%	30,89%	50,81%
Estruturado	4.373.077,01	1,69%				0,42%	1,66%	3,64%	0,90%	5,22%	11,18%	16,05%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,44%	1,26%	2,48%	1,65%	5,19%	13,99%	24,83%
Multimercado Estruturado	4.373.077,01	1,69%			1,04%	0,42%	1,66%	3,64%	0,90%	5,22%	11,18%	15,76%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	4.373.077,01	1,69%	ITAU	0,10%	1,04%	0,26%	1,08%	3,29%	0,79%	6,13%	12,70%	23,68%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,44%	1,26%	2,48%	1,65%	5,19%	13,99%	24,83%
Total	259.222.800,51	100%			0,88%	0,30%	0,67%	3,75%	0,59%	7,01%	11,20%	19,07%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,65%	3,18%	6,89%	3,79%	11,41%	19,11%	30,44%

* 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.

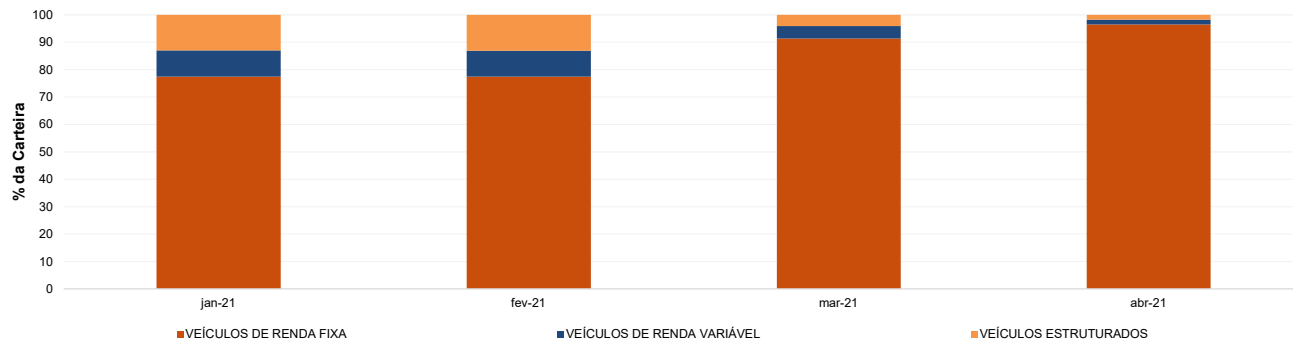
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

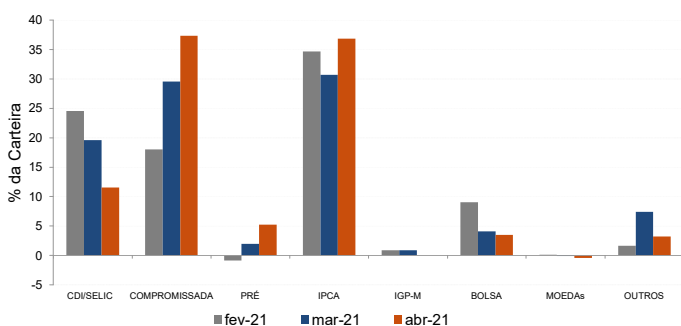
Distribuição da Carteira

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.

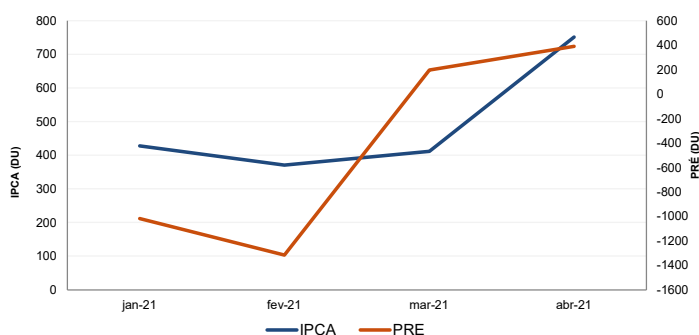
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	582,66	7,91	889,82	7,50
VALE3	Mineração	522,47	7,09	1.092,60	9,21
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	466,14	6,33	418,29	3,52
LREN3	Comércio	419,73	5,70	456,32	3,84
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	393,39	5,34	970,27	8,18
ENGI11	Energia Elétrica	342,84	4,65	312,68	2,63
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	310,79	4,22	329,08	2,77
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	288,83	3,92	692,78	5,84
TOTS3	Programas e Serviços	284,62	3,86	256,39	2,16
RAIL3	Transporte	246,49	3,35	256,34	2,16

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

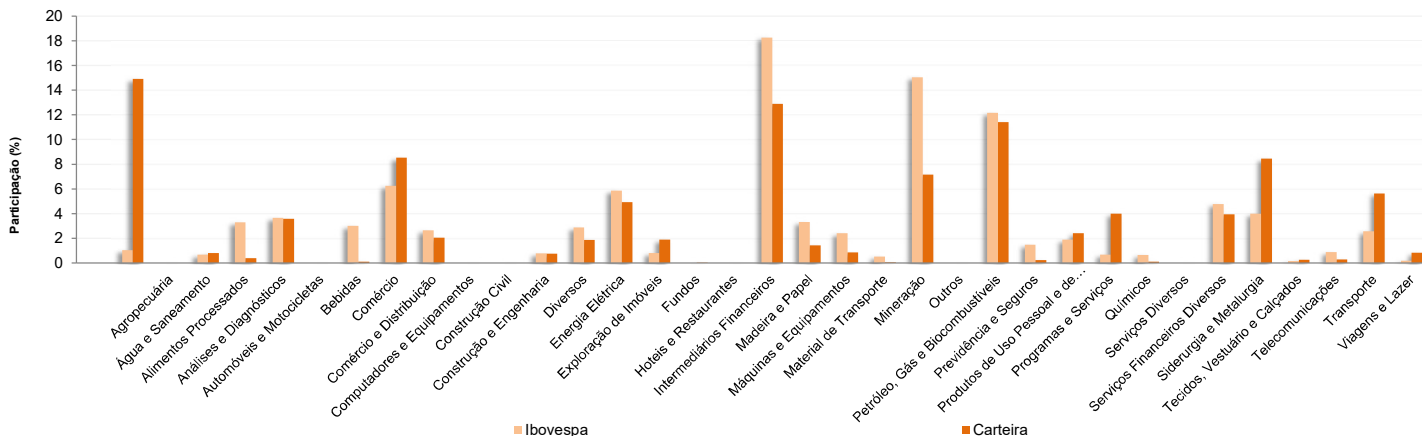
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ITUB4	582,66	7,91	0,00	1
VALE3	522,47	7,09	0,00	1
GGBR4	466,14	6,33	0,00	1
LREN3	419,73	5,70	0,00	1
PETR4	393,39	5,34	0,00	1
ENGI11	342,84	4,65	0,00	1
BRDT3	310,79	4,22	0,00	1
B3SA3	288,83	3,92	0,00	1
TOTS3	284,62	3,86	0,00	1
RAIL3	246,49	3,35	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

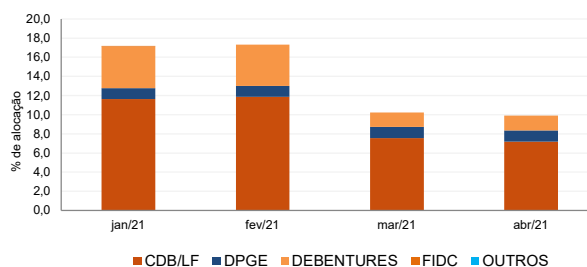
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.105,14	2,36	Faixa 2
BCO SAFRA SA	3.853,23	1,49	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	2.375,27	0,92	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	2.219,23	0,86	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.204,83	0,85	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.051,95	0,79	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.034,08	0,79	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.042,03	0,40	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.013,46	0,39	Faixa 4
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	887,51	0,34	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

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
ALGA18	15-fev-24	315.201	0,12%	CDI	ALGAR TELECOM SA	09-abr-21	1,36%	Faixa 1	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
DPGE CDI	21-dez-22	1.013.462	0,39%	CDI	OMNI SA CRED FINANC INVEST	09-abr-21	1,72%	Faixa 4	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
ESTC15	15-fev-22	1.107.041	0,43%	CDI	ESTACIO PARTICIPACOES SA	09-abr-21	1,69%	Faixa 1	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
ESTC25	15-fev-24	1.097.789	0,42%	CDI	ESTACIO PARTICIPACOES SA	09-abr-21	1,59%	Faixa 1	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LCAMA9	15-jan-26	768.181	0,30%	CDI	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	09-abr-21	2,01%	Faixa 1	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LF CDI	01-ago-25	2.141.104	0,83%	CDI	BCO BRADESCO SA	09-abr-21	108,75%	Faixa 2	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LF CDI	16-nov-29	304.851	0,12%	CDI	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	09-abr-21	1,58%	Faixa 1	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LF CDI Mensal	22-dez-22	2.051.947	0,79%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	09-abr-21	1,38%	Faixa 2	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LF IPCA	24-ago-22	1.220.921	0,47%	IPCA	BCO ITAU SA	09-abr-21	2,60%	Faixa 2	ITAPEMA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO I
LF IPCA	14-nov-22	613.544	0,24%	IPCA	BCO ITAU SA	09-abr-21	2,88%	Faixa 2	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
RDCO20	15-dez-23	167.108	0,06%	CDI	RODOVIAS COLINAS SA	09-abr-21	1,58%	Faixa 2	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
SBSPC2	15-fev-25	98.226	0,04%	IPCA	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	09-abr-21	4,65%	Faixa 2	ITAPEMA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO I
SULM28	01-fev-26	211.540	0,08%	CDI	SUL AMERICA SA	09-abr-21	1,75%	Faixa 3	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.029.385	1,56%	Selic		30-abr-21	7,00%	0,07%	ATLÂNTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	3.195.345	1,24%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.397.287	0,54%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.050.673	0,41%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2021-09-01	01-set-21	974.851	0,38%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2021-09-01	01-set-21	444.099	0,17%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2021-09-01	01-set-21	32.495	0,01%	Selic		09-abr-21	4,00%	0,04%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	64.960	0,03%	Selic		09-abr-21	7,00%	0,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2022-09-01	01-set-22	43.267	0,02%	Selic		09-abr-21	0,14%	0,14%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.356.053	0,91%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	248.574	0,10%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	32.423	0,01%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	21.615	0,01%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-09-01	01-set-23	345.396	0,13%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-09-01	01-set-23	75.555	0,03%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-09-01	01-set-23	75.555	0,03%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-09-01	01-set-23	32.381	0,01%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2023-09-01	01-set-23	10.794	0,00%	Selic		09-abr-21	0,13%	0,13%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	42.323	0,02%	Selic		14-abr-21	0,20%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	31.575	0,01%	Selic		09-abr-21	0,24%	0,25%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	7.197.768	2,78%	Selic		09-abr-21	0,28%	0,00%	ITAPEMA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO I
LFT 2026-03-01	01-mar-26	490.515	0,19%	Selic		09-abr-21	0,28%	0,00%	ITAPEMA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO I
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	746.092	0,29%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	554.136	0,21%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	430.995	0,17%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	228.174	0,09%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	220.930	0,09%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	137.629	0,05%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	57.949	0,02%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	54.327	0,02%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	39.840	0,02%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	36.218	0,01%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	36.218	0,01%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	21.731	0,01%	IPCA		09-abr-21	2,07%	-2,07%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	3.551.109	1,37%	IPCA		09-abr-21	1,55%	1,55%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.560.725	1,38%	IPCA		09-abr-21	2,20%	2,20%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	43.088	0,02%	IPCA		09-abr-21	3,20%	3,20%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	19.586	0,01%	IPCA		09-abr-21	3,20%	3,20%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.917	0,00%	IPCA		09-abr-21	3,20%	3,20%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	525.184	0,20%	IPCA		09-abr-21	3,35%	3,35%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	184.416	0,07%	IPCA		09-abr-21	3,35%	3,35%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	104.235	0,04%	IPCA		09-abr-21	3,35%	3,35%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	20.045	0,01%	IPCA		09-abr-21	3,35%	3,35%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	13.995.243	5,41%	IPCA		29-abr-21	3,36%	3,28%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.587.460	0,61%	IPCA		29-abr-21	3,37%	3,28%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	5.184.797	2,01%	IPCA		29-abr-21	3,76%	3,68%	ATLÂNTIDA 2 FUNDO DE INVESTIMENT